【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年7月7日提出
【計算期間】	第14期(自 2021年4月14日至 2022年4月13日)
【ファンド名】	ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）
【発行者名】	三井住友ＤＳ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
【連絡場所】	東京都港区虎ノ門一丁目１７番１号
【電話番号】	03-6205-1649
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

イ　当ファンドは、国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）、国内債券パッシブ・マザーファンド、外国株式インデックス・マザーファンド、外国債券パッシブ・マザーファンドおよびマネーインカム・マザーファンドの受益証券への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債および短期金融資産に分散投資を行うことにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。

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

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

ハ　当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

（イ）当ファンドが該当する商品分類

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

（ロ）当ファンドが該当する属性区分

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

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

≪商品分類表≫

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型 追加型	国内 海外 内外	株式 債券 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
株式 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 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、円短期金融資産)資産配分変更型)) 資産複合 （　） 資産配分固定型	年1回 年2回 年4回 年6回(隔月) 年12回(毎月) 日々 その他 （　）	グローバル (日本を含む) 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東(中東) エマージング	ファミリーファンド ファンド・オブ・ファンズ	あり なし

資産配分変更型				

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

（２）【ファンドの沿革】

2008年３月31日	信託契約締結、設定、運用開始。
2015年２月27日	「スミセイ・ＤＣバランスファンド（機動的資産配分型）」から「ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）」に名称を変更。

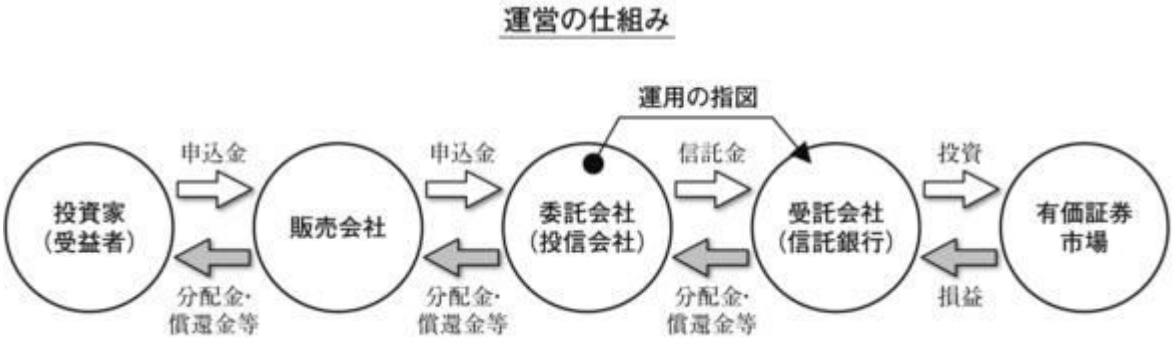
（３）【ファンドの仕組み】

イ　当ファンドの関係法人とその役割

（イ）委託会社　「三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社」
証券投資信託契約に基づき、信託財産の運用指図、投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の作成等を行います。

（ロ）受託会社　「三井住友信託銀行株式会社」
証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、株式会社日本カストディ銀行に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

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



ロ　委託会社の概況

（イ）資本金の額
20億円（2022年4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ＤＳアセットマネジメント株式会社に商号変更

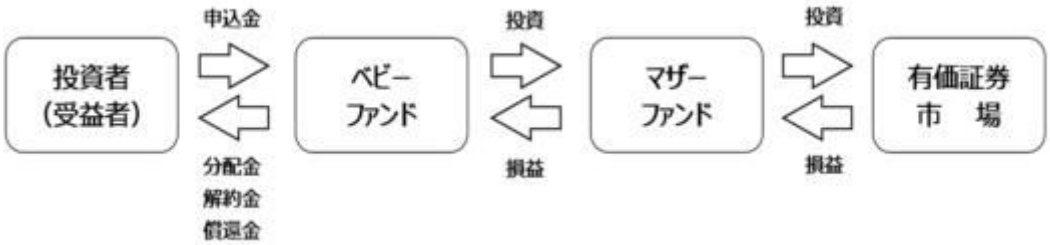
（ハ）大株主の状況

（2022年4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	大阪府大阪市中央区城見一丁目４番35号	3,528,000	10.4
三井住友信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目４番１号	337,248	1.0

ハ　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

当ファンドは、マザーファンドの受益証券への投資を通じて、信託財産の着実な成長を目指した

運用を行います。

ロ　投資態度

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

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

（ロ）委託会社が独自に作成する基本資産配分に対し一定の許容変動幅内で機動的に資産配分を変更します。

ファンドの基本資産配分ならびに各資産の許容変動幅

	資産配分				
	国内株式	国内債券	外国株式	外国債券	短期金融資産
基本	20%	50%	10%	15%	５％
上限	35%	65%	25%	30%	20%
下限	５％	35%	０％	０％	０％

（注）基本資産配分は、５年に一回程度検証を行い、必要であれば見直しを行います。

（ハ）運用にあたっては、基本資産配分に基づいて、以下の指数を合成したベンチマークを上回る投資成果を目指します。

国内株式	国内債券	外国株式	外国債券	短期金融資産
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（円ベース）	ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）	無担保コール翌日物
20%	50%	10%	15%	５％

（注）基本資産配分の見直しに伴い見直しを行います。

（ニ）実質外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

（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 日本を含む世界各国の株式、公社債および短期金融資産に分散投資することにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。

□ 実際の運用は、各資産に投資する5つのマザーファンドへの投資を通じて行います（ファミリーファンド方式）。

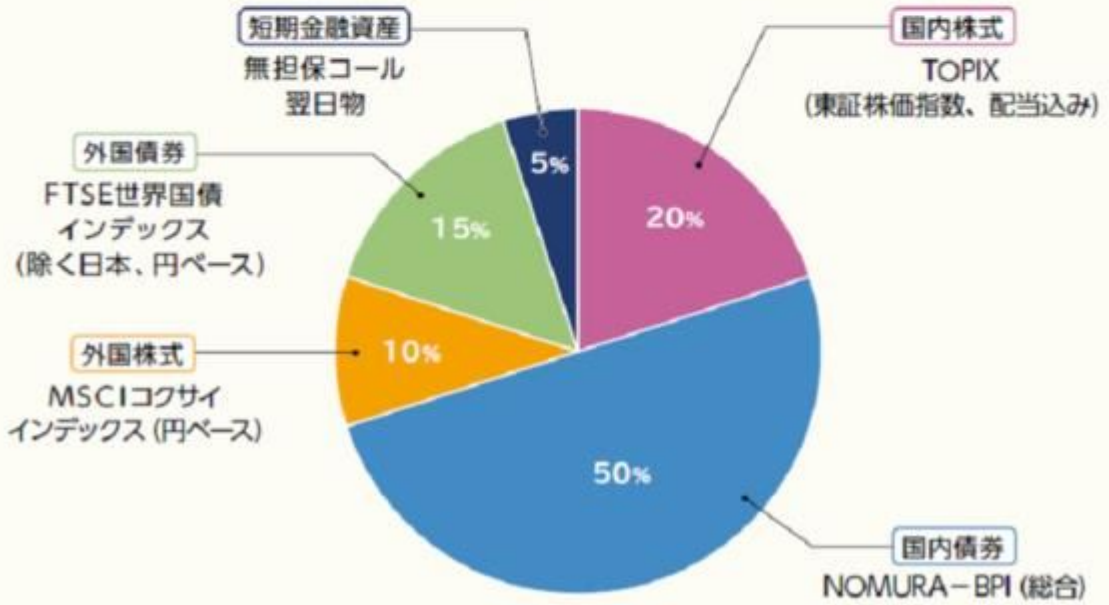
2 委託会社が独自に作成する基本資産配分に対し、一定の許容変動幅内で機動的に資産配分を変更します。

□ 基本資産配分は、5年に一回程度検証を行い、必要であれば見直しを行います。

［ファンドの基本資産配分ならびに各資産の許容変動幅］

	国内株式	国内債券	外国株式	外国債券	短期金融資産
基本資産配分	20%	50%	10%	15%	5%
変動幅	5～35%	35～65%	0～25%	0～30%	0～20%

3 運用にあたっては、基本資産配分に基づいて、以下の指数を合成したベンチマークを上回る投資成果を目指します。



※基本資産配分の見直しに伴い、ベンチマークの合成比率の見直しも行います。

4 実質外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

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

- 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各社の知的財産です。
- 指数を公表する各社は当ファンドの運用と何ら関係ありません。

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。

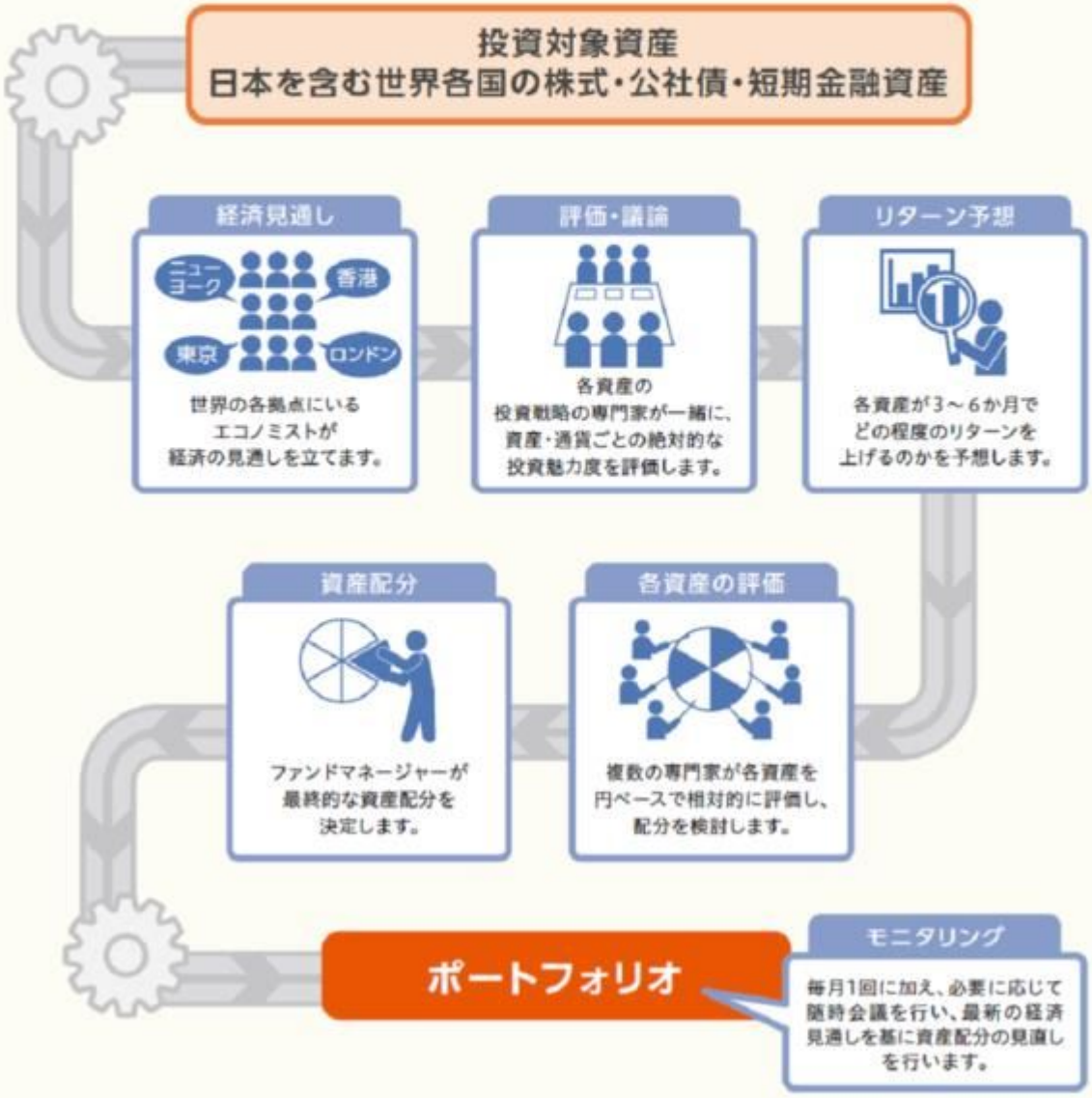
※許容変動幅内で機動的に資産配分を変更するため、すべてのマザーファンドに投資するとは限りません。

運用（資産配分）プロセス

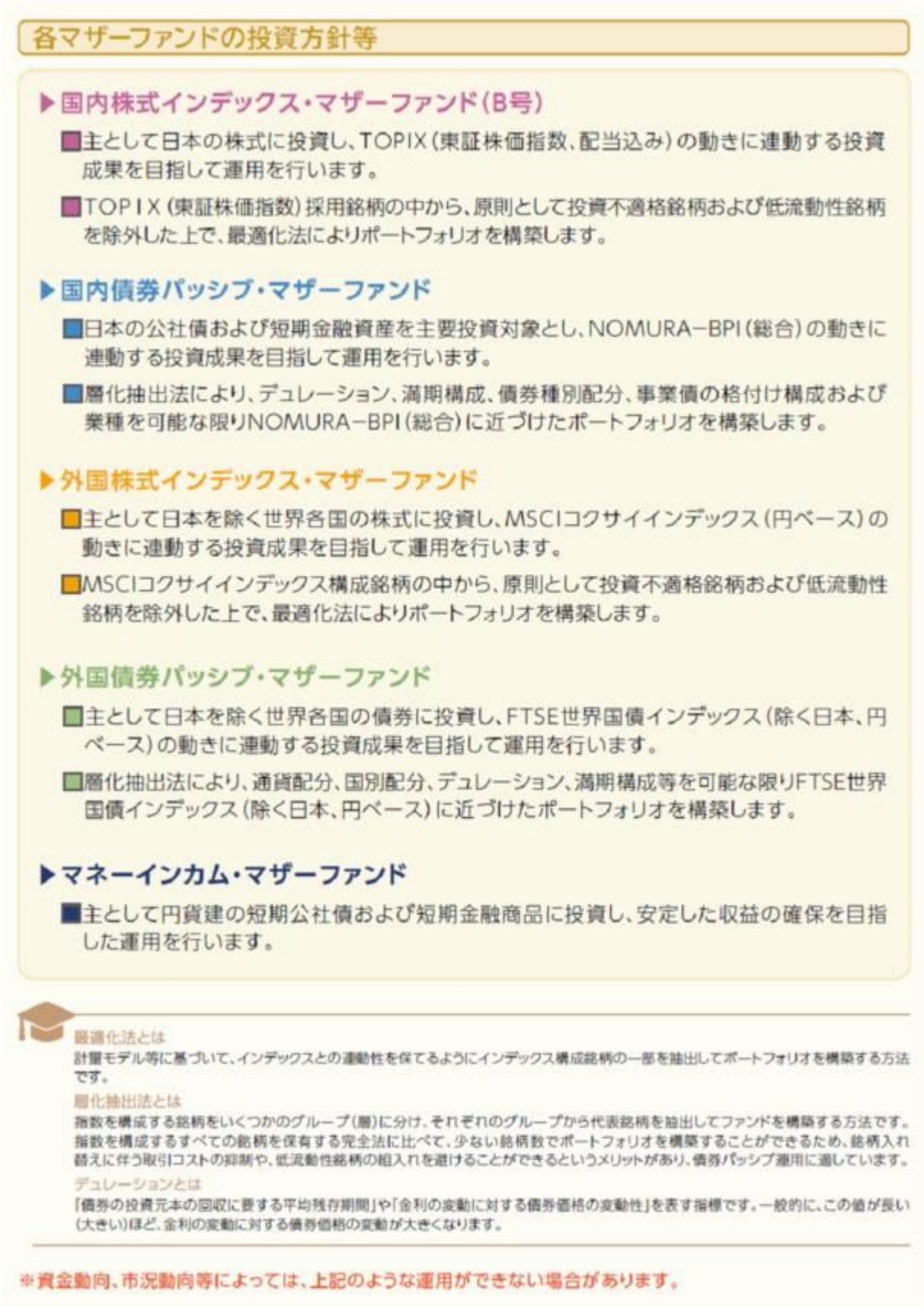
Voice

運用担当者からのメッセージ

当ファンドは、株式や債券といった伝統的な資産に分散投資を行い、これから投資を始める方にとってわかりやすいしくみのファンドです。
また、愛称の「資産配分おまかせくん」の通り、市場の動きに合わせて資産配分比率を機動的に変更し、相場が上がるときにはその恩恵を受け、下がる時には損失を抑えることを目指しています。そのため、長期的な資産形成にご活用いただけるファンドです。



※上記は、投資者の皆さまに当ファンドの運用プロセスについてわかりやすくお伝えするため、専門用語等を言い換えたり、省略している場合があります。
※上記の運用プロセスは2022年4月末現在のものであり、今後変更される場合があります。



（２）【投資対象】

イ　投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

１．有価証券

２．デリバティブ取引にかかる権利
３．約束手形
４．金銭債権

（ロ）特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

１．為替手形

ロ　投資対象とする有価証券

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

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

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

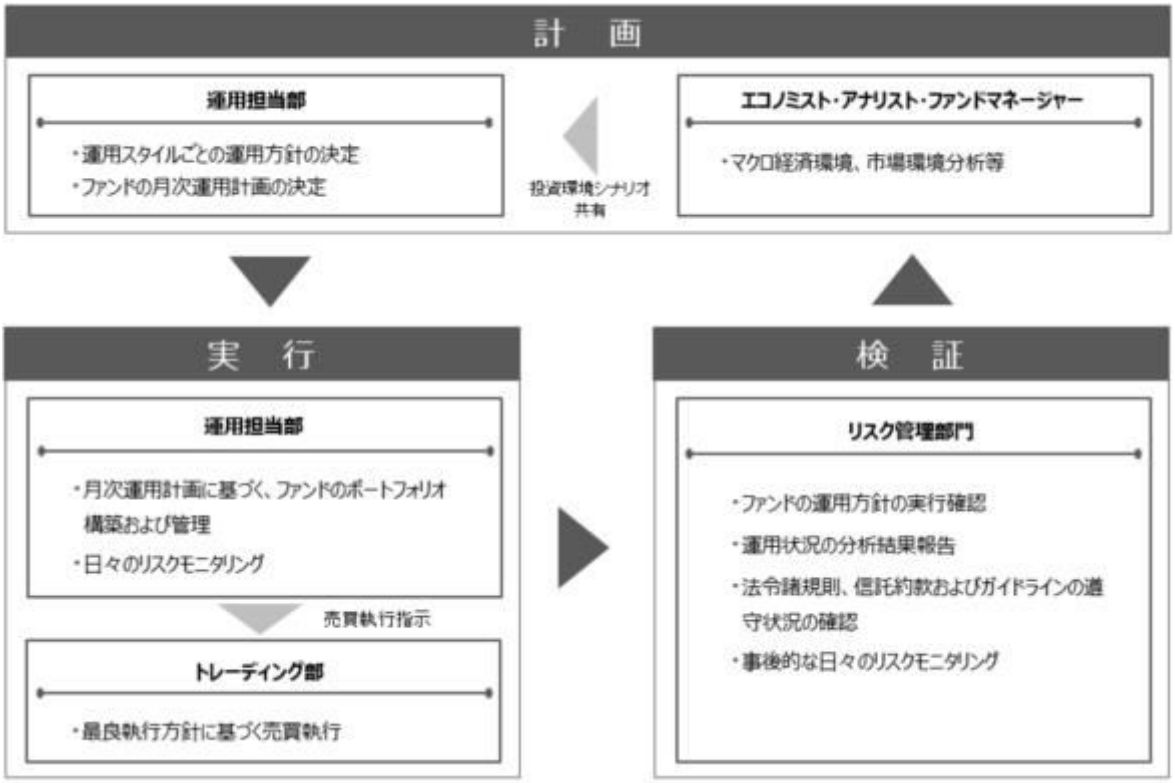
ハ　投資対象とする金融商品

委託会社は、信託金を、上記ロ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）【分配方針】

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

イ　分配対象額は、経費控除後の配当等収益と有価証券売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
ロ　収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対

象収益が少額の場合等には、委託会社の判断により収益分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

ハ　留保益の運用については、前記「（１）投資方針」に基づいて運用を行います。

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

（５）【投資制限】

Ⅰ　ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

イ　株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%以下とします。

※実質投資割合とは、当ファンドが保有するある種類の資産の評価額が当ファンドの純資産総額に占める比率（「組入比率」といいます。）と、当該同一種類の資産のマザーファンドにおける組入比率に当該マザーファンド受益証券の当ファンドにおける組入比率を乗じて得た率を合計したものをいいます（以下同じ。）。

ロ　新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

ハ　マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５％以下とします。

ニ　外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%以下とします。

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

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

Ⅱ　ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

イ　投資する株式等の範囲

（イ）委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場している株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

（ロ）上記（イ）にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録することが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとします。

ロ　信用取引の指図

（イ）委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

（ロ）信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けにかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

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

ハ　先物取引等の指図

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

（ロ）委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、日本の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

（ハ）委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

ニ　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合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

（ニ）スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。

（ホ）委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

ホ　金利先渡取引および為替先渡取引の指図

（イ）委託会社は、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、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

（ロ）金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

（ハ）金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する金利先渡取引および為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

（ニ）金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。

（ホ）委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

（ヘ）「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

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

ヘ　有価証券の貸付けの指図

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

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

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

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

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

ト　有価証券の空売りの指図

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

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

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

チ　有価証券の借入れの指図

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

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

（ハ）信託財産の一部解約等の事由により、上記（ロ）の借入れにかかる有価証券の時価総額が信託

財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。

（ニ）借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

リ　特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ヌ　外国為替予約取引の指図

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

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

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

ル　資金の借入れ

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

（ロ）一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が５営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。

（ハ）収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

（ニ）借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

ヲ　デリバティブ取引等にかかる投資制限

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

III　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

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

ハ　投資対象とする金融商品

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

（３）投資制限

イ　ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）外貨建資産への投資は行いません。

（ロ）株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

（国内債券パッシブ・マザーファンド）

（１）投資方針等

イ　基本方針

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

ロ　投資態度

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

（ロ）公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

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

（２）投資対象

イ　投資対象とする資産の種類

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

ロ　投資対象とする有価証券

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

ハ　投資対象とする金融商品

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

（３）投資制限

イ　ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

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

（ハ）投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以内とします。

（ニ）外貨建資産への投資は行いません。

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

（ヘ）デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます。）は、価格変動リスク、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。

（外国株式インデックス・マザーファンド）

（１）投資方針等

イ　基本方針

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

ロ　投資態度

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

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

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

（２）投資対象

イ　投資対象とする資産の種類

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

ロ　投資対象とする有価証券

前記「２　投資方針　（２）投資対象　ロ　投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号のうち、第１号、第２号、第４号、第５号、第10号から第21号に掲げるものに投資します（ただし、第14号に掲げるもののうち投資法人債券を除きます。）。

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

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

ロ　投資態度

（イ）ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。

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

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

を行います。
（ニ）保有する外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
（ホ）公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。
（ヘ）資金動向、市況動向等の急変により上記の運用が困難となった場合、暫定的に上記と異なる運用を行う場合があります。

（２）投資対象

イ　投資対象とする資産の種類

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

ロ　投資対象とする有価証券

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

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。

（マネーインカム・マザーファンド）

（１）投資方針等

イ　基本方針

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

ロ　投資態度

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

（２）投資対象

イ　投資対象とする資産の種類

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

ロ　投資対象とする有価証券

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

ハ　投資対象とする金融商品

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

（３）投資制限

イ　ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

（ロ）投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。

（ハ）外貨建資産への投資は行いません。

（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。

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

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

（ト）ファミリーファンド方式にかかる留意点

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

（チ）換金制限等に関する留意点

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

これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性、換金申込みの受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。

（リ）収益分配金に関する留意事項

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

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

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

ロ　投資リスクの管理体制

委託会社では、運用部門から独立した組織を設置し、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。

※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。
※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

［ ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較 ］

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

※ファンドの騰落率は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものとは異なります。
※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・マーケッツ・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0.649%（税抜き0.59%）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0.21%	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0.35%	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年0.03%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価

※上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。
※委託会社が販売会社として申込みの取扱い等をした部分については、販売会社配分相当額を委託会社が収受します。

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

※　上記ロ、ハにかかる費用に関しましては、その時々の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ったりすることから、あらかじめ具体的に記載することはできません。

（５）【課税上の取扱い】

イ　個別元本について

（イ）追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

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

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

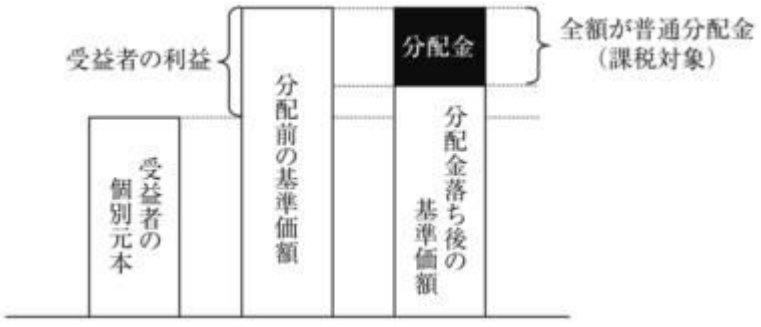
ロ　一部解約時および償還時の課税について

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

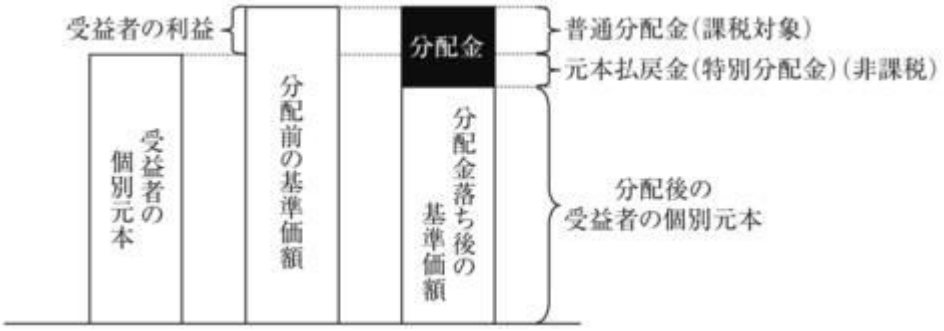
ハ　収益分配金の課税について

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

①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。



②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①、②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。

ニ　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

ⅰ．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。

ⅱ．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ます。）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。

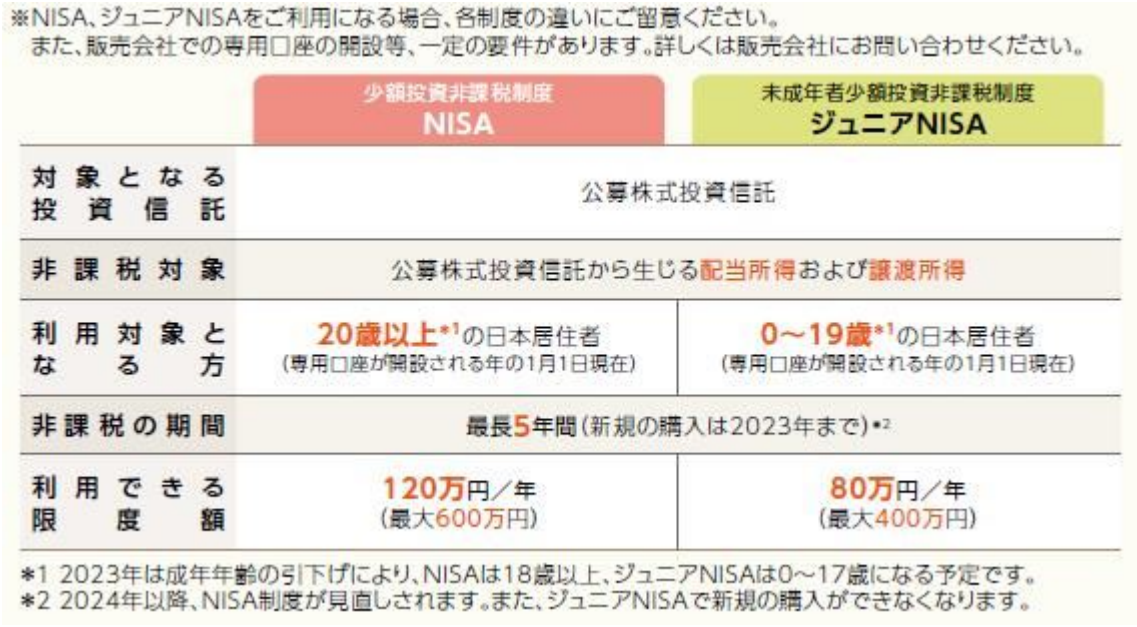
なお、当ファンドは、配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

※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4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】

ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）

2022年4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	2,109,687,971	99.59
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	8,638,610	0.41
合計（純資産総額）		2,118,326,581	100.00

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

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）

イ　主要投資銘柄

2022年4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	842,675,356	1.2558	1,058,230,864	1.2571	1,059,327,190	50.01

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）	132,436,214	3.1983	423,566,420	3.2159	425,901,620	20.11
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	61,838,357	6.1127	378,000,491	5.9396	367,295,105	17.34
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	117,929,040	1.9818	233,711,772	1.9943	235,185,884	11.10
日本	親投資信託受益証券	マネーインカム・マザーファンド	21,805,906	1.0079	21,978,172	1.0079	21,978,172	1.04

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4月28日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	99.59
合　計	99.59

②【投資不動産物件】

ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）

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5期　（2013年 4月15日）	344,598,682	344,598,682	11,105	11,105
第6期　（2014年 4月14日）	505,145,631	505,145,631	11,474	11,474
第7期　（2015年 4月13日）	715,784,521	715,784,521	13,405	13,405
第8期　（2016年 4月13日）	796,414,981	796,414,981	12,610	12,610
第9期　（2017年 4月13日）	977,932,730	977,932,730	12,972	12,972

第10期　（2018年 4月13日）	1,320,853,588	1,320,853,588	13,760	13,760
第11期　（2019年 4月15日）	1,552,047,413	1,552,047,413	13,725	13,725
第12期　（2020年 4月13日）	1,600,674,239	1,600,674,239	13,151	13,151
第13期　（2021年 4月13日）	1,936,918,108	1,936,918,108	14,953	14,953
第14期　（2022年 4月13日）	2,101,944,664	2,101,944,664	15,117	15,117
2021年 4月末日	1,940,050,826	-	14,903	-
5月末日	1,945,495,881	-	15,018	-
6月末日	1,980,468,919	-	15,094	-
7月末日	1,992,895,954	-	15,091	-
8月末日	2,021,291,152	-	15,249	-
9月末日	2,032,672,086	-	15,258	-
10月末日	2,071,226,548	-	15,414	-
11月末日	2,069,401,045	-	15,290	-
12月末日	2,113,856,238	-	15,516	-
2022年 1月末日	2,054,120,718	-	15,034	-
2月末日	2,043,780,237	-	14,948	-
3月末日	2,124,917,497	-	15,281	-
4月末日	2,118,326,581	-	15,073	-

②【分配の推移】

ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）

	計算期間	１万口当たり分配金（円）
第5期	2012年 4月14日～2013年 4月15日	0
第6期	2013年 4月16日～2014年 4月14日	0
第7期	2014年 4月15日～2015年 4月13日	0
第8期	2015年 4月14日～2016年 4月13日	0
第9期	2016年 4月14日～2017年 4月13日	0
第10期	2017年 4月14日～2018年 4月13日	0
第11期	2018年 4月14日～2019年 4月15日	0
第12期	2019年 4月16日～2020年 4月13日	0
第13期	2020年 4月14日～2021年 4月13日	0
第14期	2021年 4月14日～2022年 4月13日	0

③【収益率の推移】

ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）

	収益率（％）
第5期	16.8
第6期	3.3
第7期	16.8
第8期	△5.9
第9期	2.9

第10期	6.1
第11期	△0.3
第12期	△4.2
第13期	13.7
第14期	1.1

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

（４）【設定及び解約の実績】

ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第5期	106,946,027	28,043,591
第6期	160,191,612	30,265,804
第7期	136,804,546	43,095,045
第8期	194,983,589	97,382,992
第9期	197,626,505	75,293,446
第10期	320,825,769	114,799,604
第11期	279,269,689	108,335,313
第12期	242,872,998	156,591,024
第13期	265,845,857	187,659,232
第14期	269,771,610	174,665,780

（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4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	198,915,988,480	97.42
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	5,275,300,603	2.58
合計（純資産総額）		204,191,289,083	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	5,366,460,000	2.63
合計	買建	-	5,366,460,000	2.63

国内債券パッシブ・マザーファンド

2022年4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	108,954,764,060	81.35
地方債証券	日本	9,879,042,400	7.38

特殊債券	日本	9,366,148,746	6.99
社債券	日本	4,883,982,800	3.65
	フランス	200,637,600	0.15
	小計	5,084,620,400	3.80
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	644,217,462	0.48
合計（純資産総額）		133,928,793,068	100.00

外国株式インデックス・マザーファンド

2022年4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	255,238,814,271	67.49
	イギリス	15,901,929,775	4.21
	カナダ	14,487,967,014	3.83
	スイス	12,699,297,113	3.36
	フランス	11,259,500,425	2.98
	ドイツ	8,634,729,407	2.28
	オーストラリア	7,805,645,274	2.06
	アイルランド	6,751,661,165	1.79
	オランダ	6,415,647,894	1.70
	スウェーデン	3,568,384,209	0.94
	デンマーク	2,986,821,702	0.79
	スペイン	2,607,864,405	0.69
	香港	2,279,424,923	0.60
	イタリア	1,895,455,326	0.50
	ジャージィー	1,405,717,126	0.37
	フィンランド	1,336,252,964	0.35
	シンガポール	1,183,716,217	0.31
	ベルギー	943,986,251	0.25
	ノルウェー	843,202,304	0.22
	ケイマン諸島	786,993,346	0.21
	イスラエル	782,625,218	0.21
	バミューダ	520,545,758	0.14
	オランダ領キュラソー	396,680,974	0.10
	ルクセンブルグ	317,482,744	0.08
	ニュージーランド	271,991,421	0.07
	オーストリア	209,947,499	0.06
	ポルトガル	178,108,289	0.05
	リベリア	121,958,773	0.03
	パナマ	108,035,703	0.03
	マン島	89,013,063	0.02
	小計	362,029,400,553	95.73
投資証券	アメリカ	8,358,890,143	2.21
	オーストラリア	883,621,571	0.23

	イギリス	250,121,311	0.07
	香港	181,922,270	0.05
	フランス	166,354,864	0.04
	シンガポール	156,070,044	0.04
	カナダ	38,268,409	0.01
	小計	10,035,248,612	2.65
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	6,096,067,649	1.62
合計（純資産総額）		378,160,716,814	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	311,117,963	0.08
株価指数先物取引	買建	ドイツ	978,826,295	0.26
株価指数先物取引	買建	アメリカ	5,305,870,097	1.40
株価指数先物取引	買建	オーストラリア	232,143,135	0.06
合計	買建	-	6,827,957,490	1.81

種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	-	1,576,987,751	0.42
為替予約取引	売建	-	214,712,228	△0.06

外国債券パッシブ・マザーファンド

2022年4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	76,721,747,419	49.00
	フランス	14,349,923,128	9.16
	イタリア	12,823,255,486	8.19
	ドイツ	10,709,077,007	6.84
	スペイン	8,552,855,625	5.46
	イギリス	8,234,550,688	5.26
	ベルギー	3,319,137,737	2.12
	カナダ	3,133,167,089	2.00
	オランダ	2,815,279,544	1.80
	オーストラリア	2,463,211,241	1.57
	中国	2,349,890,592	1.50
	オーストリア	1,978,660,670	1.26
	アイルランド	1,116,554,384	0.71
	メキシコ	1,106,755,140	0.71
	フィンランド	828,283,054	0.53
	マレーシア	775,616,569	0.50
	シンガポール	675,029,018	0.43
	イスラエル	674,540,064	0.43
	ポーランド	660,706,778	0.42
	デンマーク	630,957,610	0.40
	スウェーデン	436,293,486	0.28

	ノルウェー	407,548,693	0.26
	小計	154,763,041,022	98.84
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	1,813,589,064	1.16
合計（純資産総額）		156,576,630,086	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	-	599,468	0.00
為替予約取引	売建	-	430,739,834	△0.28

マネーインカム・マザーファンド

2022年4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	300,037,400	15.41
特殊債券	日本	1,195,885,400	61.44
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	450,516,412	23.15
合計（純資産総額）		1,946,439,212	100.00

（２）投資資産

①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4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	3,828,200	2,006.07	7,679,644,859	2,235.50	8,557,941,100	4.19
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	489,700	13,730.40	6,723,775,206	11,220.00	5,494,434,000	2.69
日本	株式	キーエンス	電気機器	70,800	69,666.98	4,932,422,505	52,850.00	3,741,780,000	1.83
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	4,724,500	604.70	2,856,897,335	754.30	3,563,690,350	1.75
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	821,400	3,158.83	2,594,664,937	3,847.00	3,159,925,800	1.55
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	49,600	59,619.84	2,957,144,252	55,480.00	2,751,808,000	1.35
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	562,600	6,860.23	3,859,563,844	4,818.00	2,710,606,800	1.33
日本	株式	任天堂	その他製品	44,100	50,525.19	2,228,160,770	59,910.00	2,642,031,000	1.29
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	460,100	5,965.32	2,744,645,933	5,269.00	2,424,266,900	1.19
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	559,200	3,331.02	1,862,707,952	4,335.00	2,424,132,000	1.19
日本	株式	三菱商事	卸売業	552,800	3,410.54	1,885,344,163	4,383.00	2,422,922,400	1.19
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	614,300	3,054.50	1,876,379,168	3,769.00	2,315,296,700	1.13

日本	株式	信越化学工業	化学	128,000	19,000.82	2,432,105,165	17,985.00	2,302,080,000	1.13
日本	株式	日立製作所	電気機器	375,900	6,647.59	2,498,830,794	6,072.00	2,282,464,800	1.12
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	600,800	3,108.30	1,867,469,597	3,419.00	2,054,135,200	1.01
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	521,800	3,716.43	1,939,230,610	3,915.00	2,042,847,000	1.00
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	512,500	3,277.13	1,679,528,694	3,932.00	2,015,150,000	0.99
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	152,500	17,813.06	2,716,491,773	12,990.00	1,980,975,000	0.97
日本	株式	第一三共	医薬品	598,500	2,817.32	1,686,165,688	3,262.00	1,952,307,000	0.96
日本	株式	ダイキン工業	機械	94,800	23,201.63	2,199,514,792	20,045.00	1,900,266,000	0.93
日本	株式	三井物産	卸売業	584,400	2,566.41	1,499,808,785	3,150.00	1,840,860,000	0.90
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,162,100	1,557.51	1,809,982,072	1,515.00	1,760,581,500	0.86
日本	株式	村田製作所	電気機器	224,100	8,385.14	1,879,110,282	7,794.00	1,746,635,400	0.86
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	85,400	17,940.94	1,532,156,476	19,775.00	1,688,785,000	0.83
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	236,300	5,747.18	1,358,058,758	7,019.00	1,658,589,700	0.81
日本	株式	日本電産	電気機器	193,000	12,934.05	2,496,271,655	8,539.00	1,648,027,000	0.81
日本	株式	セブン＆アイ・ホールディングス	小売業	286,900	4,585.67	1,315,627,978	5,718.00	1,640,494,200	0.80
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	963,900	1,407.18	1,356,378,821	1,578.50	1,521,516,150	0.75
日本	株式	ＳＭＣ	機械	22,900	72,346.12	1,656,726,133	63,050.00	1,443,845,000	0.71
日本	株式	ファナック	電気機器	68,600	22,206.24	1,523,347,749	20,165.00	1,383,319,000	0.68

ロ　種類別・業種別投資比率

2022年4月28日現在

種類	業種	投資比率（%）
株式（国内）	水産・農林業	0.10
	鉱業	0.33
	建設業	2.13
	食料品	3.26
	繊維製品	0.43
	パルプ・紙	0.20
	化学	6.29
	医薬品	5.16
	石油・石炭製品	0.46
	ゴム製品	0.66
	ガラス・土石製品	0.70
	鉄鋼	0.80
	非鉄金属	0.76
	金属製品	0.55
	機械	5.07
	電気機器	17.03
	輸送用機器	8.12

	精密機器	2.49
	その他製品	2.36
	電気・ガス業	1.18
	陸運業	3.02
	海運業	0.57
	空運業	0.40
	倉庫・運輸関連業	0.17
	情報・通信業	8.59
	卸売業	5.81
	小売業	4.06
	銀行業	5.29
	証券、商品先物取引業	0.73
	保険業	2.15
	その他金融業	1.11
	不動産業	1.96
	サービス業	5.50
合　計		97.42

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4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	４３５ ２年国債	3,480,000,000	100.14	3,484,738,000	100.14	3,484,976,400	0.005	2024/04/01	2.60
日本	国債証券	１５０ ５年国債	2,280,000,000	99.98	2,279,515,700	100.07	2,281,573,200	0.005	2026/12/20	1.70
日本	国債証券	１４６ ５年国債	1,550,000,000	100.90	1,563,950,000	100.49	1,557,610,500	0.100	2025/12/20	1.16
日本	国債証券	１４７ ５年国債	1,540,000,000	100.50	1,547,700,000	100.14	1,542,094,400	0.005	2026/03/20	1.15
日本	国債証券	３６１ １０年国債	1,310,000,000	100.24	1,313,137,400	99.19	1,299,428,300	0.100	2030/12/20	0.97
日本	国債証券	１４９ ５年国債	1,240,000,000	100.43	1,245,347,000	100.09	1,241,078,800	0.005	2026/09/20	0.93
日本	国債証券	３５９ １０年国債	1,210,000,000	100.54	1,216,537,800	99.40	1,202,715,800	0.100	2030/06/20	0.90
日本	国債証券	３６２ １０年国債	1,150,000,000	100.13	1,151,543,500	99.08	1,139,466,000	0.100	2031/03/20	0.85
日本	国債証券	４３４ ２年国債	1,130,000,000	100.09	1,130,992,600	100.14	1,131,548,100	0.005	2024/03/01	0.84
日本	国債証券	３５８ １０年国債	1,130,000,000	100.39	1,134,442,000	99.49	1,124,282,200	0.100	2030/03/20	0.84

日本	国債証券	３６０ １０年国債	1,120,000,000	100.50	1,125,622,600	99.30	1,112,137,600	0.100	2030/09/20	0.83
日本	国債証券	１４５ ５年国債	1,080,000,000	100.95	1,090,260,000	100.47	1,085,119,200	0.100	2025/09/20	0.81
日本	国債証券	１４８ ５年国債	1,070,000,000	100.53	1,075,722,300	100.12	1,071,326,800	0.005	2026/06/20	0.80
日本	国債証券	６９　２ ０年国債	1,020,000,000	106.29	1,084,137,600	104.08	1,061,605,800	2.100	2024/03/20	0.79
日本	国債証券	６５　２ ０年国債	1,020,000,000	105.22	1,073,244,000	103.23	1,052,986,800	1.900	2023/12/20	0.79
日本	国債証券	３６５ １０年国債	1,060,000,000	99.11	1,050,513,000	98.82	1,047,502,600	0.100	2031/12/20	0.78
日本	国債証券	１４４ ５年国債	980,000,000	100.89	988,722,000	100.46	984,459,000	0.100	2025/06/20	0.74
日本	国債証券	３６４ １０年国債	950,000,000	100.36	953,431,400	98.90	939,512,000	0.100	2031/09/20	0.70
日本	国債証券	３５６ １０年国債	940,000,000	100.68	946,377,600	99.71	937,245,800	0.100	2029/09/20	0.70
日本	国債証券	３５７ １０年国債	910,000,000	100.66	915,975,200	99.58	906,214,400	0.100	2029/12/20	0.68
日本	国債証券	３３３ １０年国債	815,000,000	102.08	831,927,550	101.25	825,211,950	0.600	2024/03/20	0.62
日本	国債証券	７０　２ ０年国債	780,000,000	107.78	840,660,600	105.25	820,911,000	2.400	2024/06/20	0.61
日本	国債証券	３３８ １０年国債	805,000,000	102.01	821,204,650	101.30	815,448,900	0.400	2025/03/20	0.61
日本	国債証券	３４４ １０年国債	811,000,000	101.02	819,231,650	100.50	815,087,440	0.100	2026/09/20	0.61
日本	国債証券	８８　２ ０年国債	742,000,000	112.20	832,501,740	109.62	813,395,240	2.300	2026/06/20	0.61
日本	国債証券	３３２ １０年国債	793,000,000	101.88	807,924,260	101.11	801,762,650	0.600	2023/12/20	0.60
日本	国債証券	１４１ ５年国債	795,000,000	100.76	801,033,300	100.36	797,846,100	0.100	2024/09/20	0.60
日本	国債証券	３３９ １０年国債	785,000,000	102.13	801,681,250	101.40	795,958,600	0.400	2025/06/20	0.59
日本	国債証券	３６３ １０年国債	800,000,000	100.72	805,742,600	98.97	791,752,000	0.100	2031/06/20	0.59
日本	国債証券	７２　２ ０年国債	753,000,000	107.40	808,729,530	105.14	791,674,080	2.100	2024/09/20	0.59

ロ　種類別投資比率

2022年4月28日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	81.35
地方債証券	7.38
特殊債券	6.99
社債券	3.80
合　計	99.52

外国株式インデックス・マザーファンド

イ　主要投資銘柄（上位30銘柄）

2022年4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	930,837	20,743.35	19,308,678,168	20,175.61	18,780,204,471	4.97
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	404,747	43,225.00	17,495,189,191	36,495.73	14,771,536,906	3.91
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	25,910	457,034.92	11,841,774,840	356,083.99	9,226,136,243	2.44
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	48,490	145,556.04	7,058,012,232	113,591.38	5,508,045,948	1.46
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	17,091	374,410.33	6,399,047,021	294,559.79	5,034,321,292	1.33
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	16,249	375,983.35	6,109,353,381	296,430.83	4,816,704,598	1.27
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	53,590	58,612.11	3,141,023,242	66,209.56	3,548,170,138	0.94
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	149,808	20,701.74	3,101,285,864	23,465.41	3,515,305,542	0.93

アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	142,103	42,574.31	6,049,936,804	23,729.57	3,372,042,943	0.89
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	74,178	36,760.36	2,726,809,823	42,469.68	3,150,315,834	0.83
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	134,599	42,984.11	5,785,617,704	22,544.06	3,034,407,528	0.80
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	137,834	19,245.60	2,652,698,367	20,535.13	2,830,439,053	0.75
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	160,218	15,970.63	2,558,781,714	16,639.08	2,665,880,119	0.70
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	168,263	20,617.19	3,469,109,693	15,646.18	2,632,673,387	0.70
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	95,103	25,488.45	2,424,028,006	27,590.21	2,623,912,179	0.69
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	240,058	8,032.72	1,928,319,037	10,906.71	2,618,243,085	0.69
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	ソフトウェア・サービス	50,005	41,886.46	2,094,532,373	46,591.91	2,329,828,469	0.62
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	59,526	51,820.65	3,084,675,833	38,864.18	2,313,428,940	0.61
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	109,842	15,047.68	1,652,867,205	20,133.09	2,211,458,476	0.58
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	320,083	6,752.68	2,161,419,147	6,409.50	2,051,570,836	0.54
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	100,824	15,309.90	1,543,604,888	20,310.91	2,047,827,512	0.54

アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	234,195	7,082.39	1,658,659,632	8,448.06	1,978,493,786	0.52
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	419,938	5,844.61	2,454,372,586	4,671.18	1,961,603,887	0.52
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	40,075	47,601.76	1,907,640,542	48,408.83	1,939,983,661	0.51
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	食品・生活必需品小売り	25,216	71,584.93	1,805,085,513	71,398.75	1,800,390,849	0.48
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	78,962	21,191.76	1,673,344,015	22,531.17	1,779,106,324	0.47
アメリカ	株式	WALMART INC	食品・生活必需品小売り	87,595	18,429.86	1,614,363,505	19,875.37	1,740,982,719	0.46
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	46,434	33,099.67	1,536,949,896	36,736.70	1,705,831,807	0.45
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	23,489	73,199.60	1,719,385,417	72,102.32	1,693,611,497	0.45
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	23,576	95,094.24	2,241,941,892	71,813.32	1,693,070,855	0.45

ロ　種類別・業種別投資比率

2022年4月28日現在

種類	業種	投資比率（%）
株式（外国）	エネルギー	4.68
	素材	4.46
	資本財	5.97
	商業・専門サービス	1.17
	運輸	1.90
	自動車・自動車部品	2.24
	耐久消費財・アパレル	1.61
	消費者サービス	1.80

	小売	5.00
	食品・生活必需品小売り	1.62
	食品・飲料・タバコ	4.25
	家庭用品・パーソナル用品	1.77
	ヘルスケア機器・サービス	4.88
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.59
	銀行	5.78
	各種金融	4.60
	保険	3.14
	不動産	0.37
	ソフトウェア・サービス	10.83
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.44
	半導体・半導体製造装置	4.37
	電気通信サービス	1.53
	公益事業	3.13
	メディア・娯楽	5.61
投資証券	―	2.65
合　計		98.39

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4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	13,141.66	1,964,677,906	12,296.98	1,838,398,650	1.625	2026/05/15	1.17
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,300,000	13,485.97	1,793,634,297	12,617.20	1,678,087,339	2.250	2026/03/31	1.07
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,000,000	14,127.18	1,271,446,156	12,899.01	1,160,911,337	2.875	2028/05/15	0.74
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,500,000	13,614.83	1,157,260,733	12,732.91	1,082,297,717	2.500	2026/02/28	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,000,000	12,794.77	1,023,581,369	12,531.64	1,002,530,800	0.125	2023/08/15	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,700,000	12,841.16	988,769,067	12,618.10	971,593,704	0.250	2023/06/15	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,500,000	12,599.03	1,070,917,446	11,201.67	952,142,029	1.125	2031/02/15	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,700,000	12,732.91	980,434,402	12,349.30	950,895,953	0.125	2024/02/15	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,800,000	12,101.76	1,064,954,707	10,804.01	950,752,790	0.625	2030/08/15	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,100,000	13,014.86	924,055,060	12,135.91	861,649,321	1.375	2026/08/31	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,500,000	13,290.10	863,856,822	12,782.78	830,880,904	2.125	2024/03/31	0.53

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,200,000	12,392.60	892,266,844	11,393.93	820,362,964	0.625	2027/12/31	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,500,000	12,127.92	909,593,746	10,862.38	814,678,692	0.625	2030/05/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,200,000	13,193.98	818,026,474	12,646.32	784,071,864	1.750	2024/06/30	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	12,342.34	863,963,776	10,996.78	769,774,847	0.875	2030/11/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,700,000	12,475.19	835,838,019	11,453.33	767,373,412	0.750	2028/01/31	0.49
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,800,000	14,087.88	817,097,046	12,810.67	743,018,895	0.000	2030/08/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	13,418.45	764,851,622	12,865.77	733,348,831	2.500	2024/05/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,600,000	13,412.01	751,072,365	12,797.34	716,651,281	2.375	2024/08/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	12,775.70	728,214,662	12,472.62	710,939,175	0.125	2023/10/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	12,914.09	774,845,488	11,754.35	705,261,088	1.375	2028/10/31	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	13,111.51	721,132,775	12,508.44	687,964,211	1.500	2024/10/31	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,900,000	12,618.10	744,467,903	11,518.80	679,608,928	1.000	2028/07/31	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	13,455.17	686,213,905	12,941.28	660,005,327	2.750	2024/02/15	0.42
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4,400,000	16,622.60	731,394,564	14,882.62	654,835,343	3.500	2030/03/01	0.42
フランス	国債証券	FRANCE OAT.	4,800,000	13,777.24	661,307,371	13,536.41	649,747,694	0.000	2024/03/25	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	13,388.30	682,803,110	12,738.97	649,687,507	2.250	2024/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	13,300.67	665,033,574	12,929.17	646,458,405	2.500	2023/08/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,200,000	12,835.62	667,452,018	12,265.80	637,821,434	0.750	2024/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	12,855.72	642,785,895	12,672.99	633,649,721	0.250	2023/04/15	0.40

ロ　種類別投資比率

2022年4月28日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	98.84
合　計	98.84

マネーインカム・マザーファンド

イ　主要投資銘柄

2022年4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	特殊債券	４２　政保日本政策	200,000,000	100.03	200,054,800	100.02	200,044,000	0.001	2022/09/26	10.28
日本	特殊債券	１８２　政保道路機構	123,000,000	100.71	123,870,102	100.66	123,813,645	0.834	2023/01/31	6.36
日本	特殊債券	１９　政保政策投資Ｃ	100,000,000	100.67	100,667,700	100.62	100,618,000	0.668	2023/03/15	5.17
日本	特殊債券	１８９　政保道路機構	100,000,000	100.62	100,615,000	100.58	100,581,100	0.541	2023/04/28	5.17
日本	特殊債券	１８０　政保道路機構	100,000,000	100.56	100,557,200	100.51	100,513,500	0.734	2022/12/28	5.16
日本	特殊債券	１７７　政保道路機構	100,000,000	100.55	100,546,300	100.50	100,502,400	0.805	2022/11/30	5.16
日本	特殊債券	１７０　政保道路機構	100,000,000	100.33	100,326,100	100.30	100,299,000	0.801	2022/08/31	5.15
日本	特殊債券	１６６　政保道路機構	100,000,000	100.20	100,197,100	100.16	100,158,200	0.895	2022/06/30	5.15
日本	特殊債券	１６３　政保道路機構	100,000,000	100.13	100,127,300	100.09	100,087,700	0.901	2022/05/31	5.14
日本	特殊債券	２２９　政保預金保険	100,000,000	100.04	100,038,900	100.04	100,040,500	0.100	2022/07/29	5.14
日本	国債証券	１０６７国庫短期証券	100,000,000	100.03	100,026,300	100.02	100,021,400	0.000	2022/06/27	5.14
日本	国債証券	１０６２国庫短期証券	100,000,000	100.02	100,018,800	100.01	100,013,400	0.000	2022/06/06	5.14
日本	国債証券	１０５５国庫短期証券	100,000,000	100.01	100,008,900	100.00	100,002,600	0.000	2022/05/09	5.14
日本	特殊債券	４０政保地方公共団	69,000,000	100.37	69,252,264	100.33	69,227,355	0.819	2022/09/16	3.56

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4月28日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	15.41
特殊債券	61.44
合　計	76.85

②投資不動産物件

国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）

該当事項はありません。

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

マネーインカム・マザーファンド

該当事項はありません。

③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4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　０４０６月　２０２２年６月	買建	282	日本・円	5,398,210,200	5,366,460,000	2.63

（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4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	ＩＣＥ－ＥＵ	ＦＴＳＥ　１００　ＩＤＸ　ＦＵＴ　ＪＵＮ２２ 2022年6月	買建	26	イギリス・ポンド	1,930,182.00	311,801,600	1,925,950.00	311,117,963	0.08
	ドイツ	ＥＵＲＥＸ	ＥＵＲＯ　ＳＴＯＸＸ　５０　ＪＵＮ２２ 2022年6月	買建	197	ユーロ	7,352,839.00	998,736,121	7,206,260.00	978,826,295	0.26
	アメリカ	シカゴ商品取引所	Ｓ＆Ｐ５００　ＥＭＩＮＩ　ＦＵＴ　ＪＵＮ２２ 2022年6月	買建	197	アメリカ・ドル	42,744,151.00	5,508,011,297	41,175,462.50	5,305,870,097	1.40

	オーストラリア	シドニー先物取引所	ＳＰＩ２００ＦＵＴＵＲＥＳＪＵＮ２２ 2022年6月	買建	14	オーストラリア・ドル	2,597,413.00	238,182,772	2,531,550.00	232,143,135	0.06

（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4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	買建	9,590,000.00	1,229,889,619	1,235,406,551	0.33
	ユーロ	買建	950,000.00	129,038,313	129,048,687	0.03
	スイス・フラン	買建	350,000.00	46,452,980	46,520,900	0.01
	カナダ・ドル	買建	450,000.00	45,020,145	45,188,085	0.01
	オーストラリア・ドル	買建	430,000.00	39,250,268	39,423,775	0.01
	イギリス・ポンド	買建	170,000.00	27,450,121	27,451,600	0.01
	スウェーデン・クローナ	買建	1,180,000.00	15,363,357	15,419,291	0.00
	香港・ドル	買建	780,000.00	12,730,830	12,805,728	0.00
	デンマーク・クローネ	買建	690,000.00	12,597,196	12,599,400	0.00
	シンガポール・ドル	買建	70,000.00	6,497,073	6,523,931	0.00
	ノルウェー・クローネ	買建	220,000.00	3,038,460	3,034,811	0.00
	イスラエル・シュケル	買建	70,000.00	2,714,844	2,724,434	0.00
	ニュージーランド・ドル	買建	10,000.00	837,960	840,558	0.00
	アメリカ・ドル	売建	1,390,000.00	177,351,907	179,093,438	△0.05
	カナダ・ドル	売建	120,000.00	12,023,628	12,052,404	△0.00
	スイス・フラン	売建	80,000.00	10,664,960	10,632,584	△0.00
	デンマーク・クローネ	売建	160,000.00	2,943,872	2,921,600	△0.00
	ユーロ	売建	20,000.00	2,737,878	2,716,696	△0.00
	スウェーデン・クローナ	売建	200,000.00	2,629,700	2,613,760	△0.00
	ノルウェー・クローネ	売建	150,000.00	2,100,930	2,069,640	△0.00
	オーストラリア・ドル	売建	20,000.00	1,835,324	1,833,854	△0.00
	イスラエル・シュケル	売建	20,000.00	780,020	778,252	△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4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	ユーロ	買建	3,554.17	485,499	482,779	0.00
	アメリカ・ドル	買建	905.66	115,782	116,689	0.00
	アメリカ・ドル	売建	1,846,251.00	235,598,096	237,878,733	△0.15
	ユーロ	売建	1,419,821.00	194,426,170	192,861,101	△0.12

（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。

マネーインカム・マザーファンド

該当事項はありません。

≪参考情報≫

基準日:2022年4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

※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

分配の推移

決算期	分配金
2022年4月	0円
2021年4月	0円
2020年4月	0円
2019年4月	0円
2018年4月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。
※直近5計算期間を記載しています。

主要な資産の状況

■SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	99.59
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.41
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	50.01
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	20.11
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	17.34
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	11.10
日本	親投資信託受益証券	マネーインカム・マザーファンド	1.04

■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	97.42
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.58
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 2.63%

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	4.19
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2.69
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.83
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.75
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.55
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	1.35
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1.33
日本	株式	任天堂	その他製品	1.29
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.19
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1.19

※比率は、ファンド、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。
※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

■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	81.35
地方債証券	日本	7.38
特殊債券	日本	6.99
社債券	日本	3.65
	フランス	0.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.48
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	435 2年国債	0.005	2024/04/01	2.60
日本	国債証券	150 5年国債	0.005	2026/12/20	1.70
日本	国債証券	146 5年国債	0.100	2025/12/20	1.16
日本	国債証券	147 5年国債	0.005	2026/03/20	1.15
日本	国債証券	361 10年国債	0.100	2030/12/20	0.97
日本	国債証券	149 5年国債	0.005	2026/09/20	0.93
日本	国債証券	359 10年国債	0.100	2030/06/20	0.90
日本	国債証券	362 10年国債	0.100	2031/03/20	0.85
日本	国債証券	434 2年国債	0.005	2024/03/01	0.84
日本	国債証券	358 10年国債	0.100	2030/03/20	0.84

■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	67.49
	イギリス	4.21
	カナダ	3.83
	スイス	3.36
	フランス	2.98
	ドイツ	2.28
	その他	11.58
投資証券	アメリカ・その他	2.65
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.62
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 1.81%

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	4.97
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	3.91
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	2.44
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	1.46
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	1.33
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1.27
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	0.94
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.93
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	0.89
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	0.83

■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	49.00
	フランス	9.16
	イタリア	8.19
	ドイツ	6.84
	スペイン	5.46
	イギリス	5.26
	ベルギー	2.12
	その他	12.81
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.16
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	1.17
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2026/03/31	1.07
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.875	2028/05/15	0.74
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.500	2026/02/28	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.125	2023/08/15	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.250	2023/06/15	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.125	2031/02/15	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.125	2024/02/15	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.625	2030/08/15	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	2026/08/31	0.55

※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。

■マネーインカム・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
特殊債券	日本	61.44
国債証券	日本	15.41
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		23.15
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	特殊債券	42　政保日本政策	0.001	2022/09/26	10.28
日本	特殊債券	182　政保道路機構	0.834	2023/01/31	6.36
日本	特殊債券	19　政保政策投資C	0.668	2023/03/15	5.17
日本	特殊債券	189　政保道路機構	0.541	2023/04/28	5.17
日本	特殊債券	180　政保道路機構	0.734	2022/12/28	5.16
日本	特殊債券	177　政保道路機構	0.805	2022/11/30	5.16
日本	特殊債券	170　政保道路機構	0.801	2022/08/31	5.15
日本	特殊債券	166　政保道路機構	0.895	2022/06/30	5.15
日本	特殊債券	163　政保道路機構	0.901	2022/05/31	5.14
日本	特殊債券	229　政保預金保険	0.100	2022/07/29	5.14

※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)

※ファンドの収益率は、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います。分配実績がない場合は、基準価額の騰落率です。
※2022年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。
※ベンチマーク(合成指数)の情報は参考情報であり、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に取引口座を開設の上、当ファンドの取得申込みを行っていただきます。
当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」の２つの申込方法がありますが、販売会社によってはいずれか一方のみの取扱いとなる場合があります。お申込みの販売会社にお問い合わせください。

（ロ）原則として午後３時までに取得申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込受付分とします。
なお、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受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。）。
投資対象とする親投資信託受益証券は、当該親投資信託受益証券の基準価額で評価します。
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ます。また、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。

＜主要投資対象の評価方法＞

主要投資対象	有価証券等の評価方法
株式、投資証券、債券等	(1)　金融商品取引所等に上場されている有価証券 原則として、金融商品取引所、外国金融商品市場の最終相場で評価します。 (2)　金融商品取引所等に上場されていない有価証券 原則として、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）、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ます。
市場デリバティブ取引	原則として、金融商品取引所、外国金融商品市場の発表する清算値段または最終相場で評価します。

※国内で取引される資産については原則として基準価額計算日の値、外国で取引される資産については原則として基準価額計算日に知りうる直近の日の値で評価します。

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、「おまかせ」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】

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

（４）【計算期間】

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

（５）【その他】

イ　信託の終了

（イ）信託契約の解約

ａ．委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、残存口数が１億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

ｂ．委託会社は、上記ａの事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の２週間前までに、当ファンドの知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

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、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れ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使することができる受益者の議決権の３分の２以上に当たる多数をもって行います。

ｅ．上記ｂ～ｄまでの取扱いは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記ｂ～ｄまでの取扱いを行うことが困難な場合も同様とします。

（ロ）信託契約に関する監督官庁の命令

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

（ハ）委託会社の登録取消等に伴う取扱い

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

（ニ）受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

ｂ．上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。

ｃ．委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。

ロ　収益分配金、償還金の支払い

（イ）収益分配金

ａ．分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

ハ　信託約款の変更等

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

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

（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、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

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

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

ニ　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も、何らの意思表示もない場合は、自動的に１年間更新されます。販売契約の内容は、必要に応じて、委託会社と販売会社との合意により変更されることがあります。

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ます。）に支払われます。

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

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

ロ　償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

ハ　一部解約実行請求権

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

ニ　書面決議における議決権

委託会社が、当ファンドの解約（監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。）または、重大な信託約款の変更等を行おうとする場合において、受益者は、それぞれの書面決議手続きにおいて、受益権の口数に応じて議決権を有しこれを行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14期（2021年4月14日から2022年4月13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】

【ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第13期 （2021年 4月13日現在）	第14期 （2022年 4月13日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	9,580,417	321,669
コール・ローン	4,965,129	12,339,012
親投資信託受益証券	1,929,003,191	2,093,898,903
未収入金	590,000	5,000,000
流動資産合計	1,944,138,737	2,111,559,584
資産合計	1,944,138,737	2,111,559,584
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,299,994	2,849,560
未払受託者報酬	298,516	341,072
未払委託者報酬	5,572,250	6,367,451
未払利息	13	-
その他未払費用	49,856	56,837
流動負債合計	7,220,629	9,614,920
負債合計	7,220,629	9,614,920
純資産の部		
元本等		
元本	1,295,316,193	1,390,422,023
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	641,601,915	711,522,641
（分配準備積立金）	241,336,223	229,117,187
元本等合計	1,936,918,108	2,101,944,664
純資産合計	1,936,918,108	2,101,944,664
負債純資産合計	1,944,138,737	2,111,559,584

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期 自　2020年 4月14日 至　2021年 4月13日	第14期 自　2021年 4月14日 至　2022年 4月13日
営業収益		
受取利息	-	138
有価証券売買等損益	237,544,023	33,615,712
営業収益合計	237,544,023	33,615,850
営業費用		
支払利息	7,253	8,398
受託者報酬	576,793	668,164
委託者報酬	10,766,713	12,473,185
その他費用	97,679	112,477
営業費用合計	11,448,438	13,262,224
営業利益又は営業損失（△）	226,095,585	20,353,626
経常利益又は経常損失（△）	226,095,585	20,353,626
当期純利益又は当期純損失（△）	226,095,585	20,353,626
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（△）	15,640,884	2,947,910
期首剰余金又は期首欠損金（△）	383,544,671	641,601,915
剰余金増加額又は欠損金減少額	107,783,384	139,342,167
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	107,783,384	139,342,167
剰余金減少額又は欠損金増加額	60,180,841	86,827,157
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	60,180,841	86,827,157
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（△）	641,601,915	711,522,641

（３）【注記表】

（重要な会計方針の注記）

項　目	第14期 自 2021年4月14日 至 2022年4月13日
１．有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。

（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13期 （2021年4月13日現在）	第14期 （2022年4月13日現在）
１．当計算期間の末日における受益権の総数	1,295,316,193口	1,390,422,023口
２．１単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　1.4953円 （１万口当たりの純資産額14,953円）	1口当たり純資産額　1.5117円 （１万口当たりの純資産額15,117円）

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項　目	第13期 自 2020年4月14日 至 2021年4月13日	第14期 自 2021年4月14日 至 2022年4月13日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（23,963,314円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（102,543,630円）、収益調整金（574,306,815円）、および分配準備積立金（114,829,279円）より、分配対象収益は815,643,038円（１万口当たり6,296.83円）でありますが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（17,288,267円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（117,449円）、収益調整金（664,138,264円）、および分配準備積立金（211,711,471円）より、分配対象収益は893,255,451円（１万口当たり6,424.35円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	第14期 自 2021年4月14日 至 2022年4月13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。

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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	第14期 （2022年4月13日現在）
１．　貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 　「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） 　デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 　これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第13期（自 2020年4月14日　至 2021年4月13日）

種　類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	154,862,082円
合計	154,862,082円

第14期（自 2021年4月14日　至 2022年4月13日）

種　類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,489,971円
合計	1,489,971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14期 自 2021年4月14日 至 2022年4月13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13期 （2021年4月13日現在）	第14期 （2022年4月13日現在）
期首元本額	1,217,129,568円	1,295,316,193円
期中追加設定元本額	265,845,857円	269,771,610円
期中一部解約元本額	187,659,232円	174,665,780円

（４）【附属明細表】

①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）	128,286,319	410,426,420	
	外国株式インデックス・マザーファンド	48,029,718	293,000,491	

	外国債券パッシブ・マザーファンド	158,413,037	313,942,956	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	839,744,278	1,054,550,864	
	マネーインカム・マザーファンド	21,805,906	21,978,172	
	親投資信託受益証券　小計		2,093,898,903	
合　計			2,093,898,903	

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）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」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」および「マネーインカム・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）

（１）貸借対照表

（単位：円）

	（2021年4月13日現在）	（2022年4月13日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,169,715,889	35,806,941
コール・ローン	605,779,870	1,373,532,285
株式	191,803,100,950	197,920,121,230
派生商品評価勘定	5,553,800	19,744,700
未収入金	1,085,600	-
未収配当金	1,738,508,396	2,365,057,715
前払金	7,000,000	139,360,000
差入委託証拠金	3,460,000	157,590,000
流動資産合計	195,334,204,505	202,011,212,871
資産合計	195,334,204,505	202,011,212,871
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	12,745,200	92,875,700
未払解約金	62,155,249	51,245,960
未払利息	1,659	-
その他未払費用	15,207	9,440
流動負債合計	74,917,315	144,131,100
負債合計	74,917,315	144,131,100
純資産の部		

元本等		
元本	60,307,285,983	63,097,233,521
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	134,952,001,207	138,769,848,250
元本等合計	195,259,287,190	201,867,081,771
純資産合計	195,259,287,190	201,867,081,771
負債純資産合計	195,334,204,505	202,011,212,871

（2）注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2021年4月14日 至 2022年4月13日
１．有価証券の評価基準及び評価方法	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。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
２．デリバティブの評価基準及び評価方法	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。
３．収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。

（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4月13日現在）	（2022年4月13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　　3,402,800,000円	
２．当計算期間の末日における受益権の総数	60,307,285,983口	63,097,233,521口
３．１単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　3.2377円 （１万口当たりの純資産額32,377円）	1口当たり純資産額　3.1993円 （１万口当たりの純資産額31,993円）

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	自 2021年4月14日 至 2022年4月13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	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。 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、上下限値、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。 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。
４．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	（2022年4月13日現在）
１．貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．時価の算定方法	(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

（2021年4月13日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区　分	種　類	契　約　額　等		時　価	評価損益
			うち１年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建				
	TOPIX先物	3,420,201,400	-	3,413,010,000	△7,191,400
	小計	3,420,201,400	-	3,413,010,000	△7,191,400
合　計		3,420,201,400	-	3,413,010,000	△7,191,400

（2022年4月13日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区　分	種　類	契　約　額　等		時　価	評価損益
			うち１年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建				
	TOPIX 先物 0406月	4,049,481,000	-	3,976,350,000	△73,131,000
	小計	4,049,481,000	-	3,976,350,000	△73,131,000
合　計		4,049,481,000	-	3,976,350,000	△73,131,000

（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4月14日 至 2022年4月13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4月13日現在）
開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	66,999,567,497円
同期中における追加設定元本額	10,234,596,277円
同期中における一部解約元本額	16,926,877,791円

2021年4月13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	9,403,817,844円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	874,307,630円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	4,236,443,718円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	3,147,333,103円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	140,818,938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）	4,731,866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）	21,315,752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）	62,804,297円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５（４資産タイプ）	128,333,283円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ）	101,569,258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）	197,544,642円
国内株式指数ファンド（ＴＯＰＩＸ）	1,143,235,519円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・日本株インデックスファンド	15,940,892,855円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	453,355,694円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	484,073,352円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	312,771,346円
イオン・バランス戦略ファンド	55,063,082円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	22,865,709円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	126,712,529円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	108,999,096円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	355,046,751円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	180,069,347円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	206,194,976円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	23,499,186円
三井住友ＤＳ・国内株式インデックス年金ファンド	215,426,585円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	11,380,243円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	50,121,313円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	46,060,070円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	3,257,418円
ＳＭＡＭ・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	3,060,853,074円
バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	22,670,796円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ安定成長型＜適格機関投資家限定＞	129,489,749円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	2,117,411,933円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	1,802,540,670円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	6,769,935,339円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	42,846,949円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	175,681,640円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	783,916,156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＞	49,447,751円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	279,517,682円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	882,228,687円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	687,469,840円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	2,094,565,514円

ＳＭＡＭ・バランスＶＡ株４０Ｔ＜適格機関投資家限定＞	367,759円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	45,653,025円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	54,101,733円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	35,682,955円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	17,007,263円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	134,126,377円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	271,614,480円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	72,459,636円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	43,489,672円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	7,479,610円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３０Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	50,100,640円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	670,876,217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）	175,567,216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＞	291,264,191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＞	127,955,140円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	735,634,579円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	74,013,645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＞	20,287,354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＞	50,751,185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＞	42,473,420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Ⅱ＜適格機関投資家限定＞	429,758,704円
合　計	60,307,285,983円

（2022年4月13日現在）

開示対象ファンドの 期首における当該親投資信託の元本額	60,307,285,983円
同期中における追加設定元本額	11,806,523,474円
同期中における一部解約元本額	9,016,575,936円

2022年4月13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	9,524,501,074円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	980,498,940円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	4,538,348,289円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	3,440,118,395円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	128,286,319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）	4,784,541円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２５（４資産タイプ）	20,797,656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）	64,462,163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）	154,781,571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）	133,882,770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）	242,084,389円
国内株式指数ファンド（ＴＯＰＩＸ）	1,489,236,000円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・日本株インデックスファンド	19,582,111,751円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	146,334,176円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	231,330,362円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	152,943,467円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	31,895,783円

三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	182,885,633円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	165,851,866円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	584,008,251円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	318,357,546円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	360,155,415円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	41,466,339円
三井住友ＤＳ・国内株式インデックス年金ファンド	547,071,614円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	17,456,337円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	88,881,884円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	94,685,297円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	4,047,832円
日興ＦＷＳ・日本株インデックス	582,504,321円
三井住友ＤＳ・ＴＯＰＩＸインデックス・ファンド	5,086,487円
ＳＭＡＭ・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	2,743,586,165円
バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	12,823,736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＞	97,797,524円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	1,769,964,821円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	1,640,393,274円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	6,218,766,294円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	40,740,210円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	159,471,500円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	735,491,821円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ国際分散型＜適格機関投資家限定＞	46,826,720円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	257,810,451円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	839,187,037円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	607,019,790円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	1,876,743,832円
ＳＭＡＭ・バランスＶＡ株４０Ｔ＜適格機関投資家限定＞	374,931円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	42,725,221円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	47,564,568円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	34,436,924円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	16,874,370円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	113,224,715円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	245,176,007円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	60,459,399円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	41,778,678円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	7,630,596円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３０Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	44,249,093円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	601,227,185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）	181,398,201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＞	228,400,003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＞	101,339,489円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	181,801,332円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	55,617,287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＞	43,072,081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＞	28,371,625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＞	36,568,156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Ⅱ＜適格機関投資家限定＞	67,859,289円
ＳＭＤＡＭ・日米３資産バランスオープン＜適格機関投資家限定＞	11,604,728円
合　計	63,097,233,521円

（３）附属明細表

①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	3,260.000	12,062,000	
日本水産	102,500	558.000	57,195,000	
マルハニチロ	15,800	2,374.000	37,509,200	
雪国まいたけ	8,300	1,146.000	9,511,800	
カネコ種苗	5,000	1,582.000	7,910,000	
サカタのタネ	12,100	4,155.000	50,275,500	
ホクト	8,700	1,991.000	17,321,700	
日鉄鉱業	2,400	6,730.000	16,152,000	
三井松島ホールディングス	4,800	2,025.000	9,720,000	
ＩＮＰＥＸ	396,200	1,517.000	601,035,400	
石油資源開発	12,300	2,719.000	33,443,700	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	5,600	1,638.000	9,172,800	
ヒノキヤグループ	2,900	2,324.000	6,739,600	
ショーボンドホールディングス	14,700	5,360.000	78,792,000	
ミライト・ホールディングス	33,100	1,841.000	60,937,100	
タマホーム	6,300	2,373.000	14,949,900	
ベステラ	4,200	1,192.000	5,006,400	
Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ	22,100	206.000	4,552,600	
安藤・間	51,300	884.000	45,349,200	
東急建設	32,200	660.000	21,252,000	
コムシスホールディングス	33,100	2,625.000	86,887,500	
ビーアールホールディングス	19,200	297.000	5,702,400	
高松コンストラクショングループ	6,900	2,166.000	14,945,400	
東建コーポレーション	2,900	8,770.000	25,433,000	
ヤマウラ	4,000	932.000	3,728,000	
オリエンタル白石	38,500	230.000	8,855,000	
大成建設	69,200	3,510.000	242,892,000	
大林組	239,100	898.000	214,711,800	
清水建設	224,100	723.000	162,024,300	
飛島建設	9,200	1,005.000	9,246,000	
長谷工コーポレーション	70,500	1,376.000	97,008,000	
松井建設	11,900	648.000	7,711,200	
錢高組	1,800	3,880.000	6,984,000	
鹿島建設	175,300	1,480.000	259,444,000	
不動テトラ	6,200	1,541.000	9,554,200	

大末建設	4,100	1,317.000	5,399,700		
鉄建建設	7,100	1,835.000	13,028,500		
西松建設	14,700	3,710.000	54,537,000		
三井住友建設	56,900	420.000	23,898,000		
大豊建設	3,800	4,525.000	17,195,000		
奥村組	14,000	2,997.000	41,958,000		
東鉄工業	10,800	2,153.000	23,252,400		
淺沼組	2,900	5,080.000	14,732,000		
戸田建設	99,700	744.000	74,176,800		
熊谷組	11,900	2,680.000	31,892,000		
北野建設	3,000	2,128.000	6,384,000		
矢作建設工業	12,900	777.000	10,023,300		
ピーエス三菱	9,900	558.000	5,524,200		
日本ハウスホールディングス	20,200	451.000	9,110,200		
大東建託	24,500	12,220.000	299,390,000		
新日本建設	10,900	728.000	7,935,200		
東亜道路工業	1,600	4,945.000	7,912,000		
日本道路	2,400	7,540.000	18,096,000		
東亜建設工業	6,400	2,822.000	18,060,800		
日本国土開発	24,000	542.000	13,008,000		
若築建設	5,200	1,965.000	10,218,000		
五洋建設	95,400	629.000	60,006,600		
世紀東急工業	13,000	720.000	9,360,000		
福田組	2,800	4,370.000	12,236,000		
住友林業	61,100	2,020.000	123,422,000		
日本基礎技術	8,100	810.000	6,561,000		
巴コーポレーション	14,600	460.000	6,716,000		
大和ハウス工業	221,600	3,015.000	668,124,000		
ライト工業	14,700	1,918.000	28,194,600		
積水ハウス	260,300	2,205.000	573,961,500		
北陸電気工事	6,600	750.000	4,950,000		
ユアテック	14,900	672.000	10,012,800		
日本リーテック	6,100	1,202.000	7,332,200		
四電工	3,000	1,720.000	5,160,000		
中電工	10,900	2,073.000	22,595,700		
関電工	37,500	816.000	30,600,000		
きんでん	52,900	1,565.000	82,788,500		
東京エネシス	9,700	988.000	9,583,600		
トーエネック	2,900	3,165.000	9,178,500		
住友電設	6,300	2,182.000	13,746,600		
日本電設工業	12,700	1,549.000	19,672,300		
エクシオグループ	35,500	2,158.000	76,609,000		
新日本空調	6,800	1,864.000	12,675,200		
九電工	18,500	2,844.000	52,614,000		
三機工業	15,000	1,416.000	21,240,000		
日揮ホールディングス	73,900	1,497.000	110,628,300		
中外炉工業	3,900	1,478.000	5,764,200		
ヤマト	9,800	765.000	7,497,000		

太平電業	5,700	2,693.000	15,350,100		
高砂熱学工業	21,100	1,682.000	35,490,200		
朝日工業社	4,600	1,516.000	6,973,600		
明星工業	17,400	674.000	11,727,600		
大氣社	11,700	3,005.000	35,158,500		
ダイダン	5,700	2,042.000	11,639,400		
日比谷総合設備	8,100	1,876.000	15,195,600		
テスホールディングス	5,900	1,495.000	8,820,500		
インフロニア・ホールディングス	102,000	982.000	100,164,000		
東洋エンジニアリング	12,400	636.000	7,886,400		
レイズネクスト	11,800	1,056.000	12,460,800		
ニップン	20,900	1,671.000	34,923,900		
日清製粉グループ本社	86,300	1,741.000	150,248,300		
昭和産業	7,100	2,603.000	18,481,300		
鳥越製粉	4,900	640.000	3,136,000		
中部飼料	9,400	985.000	9,259,000		
フィード・ワン	11,400	648.000	7,387,200		
日本甜菜製糖	5,300	1,615.000	8,559,500		
ＤＭ三井製糖ホールディングス	6,400	1,904.000	12,185,600		
日新製糖	4,400	1,691.000	7,440,400		
森永製菓	18,100	3,950.000	71,495,000		
中村屋	3,200	3,130.000	10,016,000		
江崎グリコ	21,100	3,700.000	78,070,000		
名糖産業	5,100	1,592.000	8,119,200		
井村屋グループ	4,900	2,187.000	10,716,300		
不二家	4,400	2,375.000	10,450,000		
山崎製パン	58,000	1,514.000	87,812,000		
モロゾフ	3,000	2,909.000	8,727,000		
亀田製菓	4,400	4,030.000	17,732,000		
寿スピリッツ	7,400	6,700.000	49,580,000		
カルビー	35,100	2,345.000	82,309,500		
森永乳業	14,300	5,170.000	73,931,000		
六甲バター	6,600	1,491.000	9,840,600		
ヤクルト本社	57,000	6,430.000	366,510,000		
明治ホールディングス	50,600	6,460.000	326,876,000		
雪印メグミルク	18,700	1,957.000	36,595,900		
プリマハム	9,100	2,163.000	19,683,300		
日本ハム	29,300	4,120.000	120,716,000		
丸大食品	8,400	1,467.000	12,322,800		
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	6,800	3,200.000	21,760,000		
柿安本店	3,000	2,294.000	6,882,000		
伊藤ハム米久ホールディングス	45,600	651.000	29,685,600		
サッポロホールディングス	26,100	2,313.000	60,369,300		
アサヒグループホールディングス	180,900	4,475.000	809,527,500		
キリンホールディングス	282,700	1,783.000	504,054,100		
宝ホールディングス	52,100	1,058.000	55,121,800		
オエノンホールディングス	25,700	309.000	7,941,300		
養命酒製造	3,800	1,744.000	6,627,200		

コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	54,100	1,417.000	76,659,700		
サントリー食品インターナショナル	51,300	4,765.000	244,444,500		
ダイドーグループホールディングス	3,900	4,730.000	18,447,000		
伊藤園	23,300	5,380.000	125,354,000		
キーコーヒー	7,700	1,986.000	15,292,200		
日清オイリオグループ	9,000	2,864.000	25,776,000		
不二製油グループ本社	16,900	1,826.000	30,859,400		
かどや製油	1,400	3,655.000	5,117,000		
Ｊ－オイルミルズ	7,700	1,563.000	12,035,100		
キッコーマン	55,300	8,570.000	473,921,000		
味の素	169,700	3,478.000	590,216,600		
ブルドックソース	4,200	1,959.000	8,227,800		
キユーピー	40,400	2,167.000	87,546,800		
ハウス食品グループ本社	28,600	2,923.000	83,597,800		
カゴメ	29,300	3,225.000	94,492,500		
焼津水産化学工業	6,500	895.000	5,817,500		
アリアケジャパン	7,100	4,810.000	34,151,000		
ニチレイ	35,100	2,388.000	83,818,800		
東洋水産	36,900	4,105.000	151,474,500		
イートアンドホールディングス	3,900	2,053.000	8,006,700		
日清食品ホールディングス	30,100	8,850.000	266,385,000		
永谷園ホールディングス	4,200	1,904.000	7,996,800		
一正蒲鉾	3,100	818.000	2,535,800		
フジッコ	7,700	2,016.000	15,523,200		
ロック・フィールド	8,200	1,450.000	11,890,000		
日本たばこ産業	412,300	2,139.000	881,909,700		
ケンコーマヨネーズ	5,500	1,418.000	7,799,000		
わらべや日洋ホールディングス	5,400	1,710.000	9,234,000		
なとり	5,200	1,941.000	10,093,200		
ピックルスコーポレーション	4,200	1,542.000	6,476,400		
ファーマフーズ	7,400	1,935.000	14,319,000		
ユーグレナ	39,700	863.000	34,261,100		
紀文食品	5,400	1,077.000	5,815,800		
ミヨシ油脂	5,300	1,122.000	5,946,600		
理研ビタミン	8,100	1,638.000	13,267,800		
片倉工業	8,700	2,149.000	18,696,300		
グンゼ	5,100	3,675.000	18,742,500		
東洋紡	30,400	1,028.000	31,251,200		
ユニチカ	24,300	273.000	6,633,900		
富士紡ホールディングス	3,600	3,070.000	11,052,000		
倉敷紡績	7,100	1,720.000	12,212,000		
シキボウ	8,500	875.000	7,437,500		
日本毛織	22,700	942.000	21,383,400		
帝国繊維	8,900	1,647.000	14,658,300		
帝人	70,000	1,320.000	92,400,000		
東レ	541,100	606.700	328,285,370		
住江織物	2,600	1,831.000	4,760,600		

アツギ	10,200	531.000	5,416,200		
ダイニック	7,400	705.000	5,217,000		
セーレン	15,500	2,039.000	31,604,500		
小松マテーレ	13,000	1,399.000	18,187,000		
ワコールホールディングス	19,500	1,826.000	35,607,000		
ホギメディカル	10,200	3,265.000	33,303,000		
ＴＳＩホールディングス	29,400	328.000	9,643,200		
マツオカコーポレーション	3,500	1,148.000	4,018,000		
ワールド	11,000	1,308.000	14,388,000		
オンワードホールディングス	47,400	236.000	11,186,400		
ゴールドウイン	13,500	6,110.000	82,485,000		
デサント	14,500	2,666.000	38,657,000		
特種東海製紙	4,800	3,355.000	16,104,000		
王子ホールディングス	313,700	594.000	186,337,800		
日本製紙	36,700	1,019.000	37,397,300		
北越コーポレーション	49,800	653.000	32,519,400		
大王製紙	37,000	1,532.000	56,684,000		
レンゴー	72,300	735.000	53,140,500		
トーモク	5,800	1,493.000	8,659,400		
ザ・パック	6,200	2,436.000	15,103,200		
北の達人コーポレーション	28,600	230.000	6,578,000		
クラレ	109,000	1,009.000	109,981,000		
旭化成	497,600	1,057.500	526,212,000		
昭和電工	65,000	2,349.000	152,685,000		
住友化学	548,700	539.000	295,749,300		
住友精化	3,700	3,055.000	11,303,500		
日産化学	40,800	7,130.000	290,904,000		
クレハ	5,800	9,430.000	54,694,000		
多木化学	3,100	5,120.000	15,872,000		
テイカ	6,300	1,200.000	7,560,000		
石原産業	12,800	1,010.000	12,928,000		
日本曹達	9,500	3,290.000	31,255,000		
東ソー	107,700	1,713.000	184,490,100		
トクヤマ	24,100	1,643.000	39,596,300		
セントラル硝子	12,000	2,283.000	27,396,000		
東亞合成	42,100	1,079.000	45,425,900		
大阪ソーダ	6,900	3,130.000	21,597,000		
関東電化工業	16,700	971.000	16,215,700		
デンカ	27,400	3,275.000	89,735,000		
信越化学工業	128,900	17,475.000	2,252,527,500		
堺化学工業	5,600	1,853.000	10,376,800		
第一稀元素化学工業	8,400	946.000	7,946,400		
エア・ウォーター	71,200	1,639.000	116,696,800		
日本酸素ホールディングス	72,100	2,192.000	158,043,200		
日本化学工業	2,800	2,230.000	6,244,000		
日本パーカライジング	37,400	895.000	33,473,000		
高圧ガス工業	13,900	645.000	8,965,500		
四国化成工業	10,000	1,292.000	12,920,000		

ステラ　ケミファ	4,100	2,447.000	10,032,700		
保土谷化学工業	2,600	3,880.000	10,088,000		
日本触媒	12,700	5,190.000	65,913,000		
大日精化工業	6,400	1,938.000	12,403,200		
カネカ	19,300	3,395.000	65,523,500		
三菱瓦斯化学	69,500	1,853.000	128,783,500		
三井化学	67,700	2,900.000	196,330,000		
ＪＳＲ	69,900	3,455.000	241,504,500		
東京応化工業	12,200	6,860.000	83,692,000		
大阪有機化学工業	6,400	2,990.000	19,136,000		
三菱ケミカルホールディングス	502,400	776.400	390,063,360		
ＫＨネオケム	12,300	2,536.000	31,192,800		
ダイセル	108,600	761.000	82,644,600		
住友ベークライト	11,800	4,390.000	51,802,000		
積水化学工業	156,500	1,649.000	258,068,500		
日本ゼオン	67,800	1,306.000	88,546,800		
アイカ工業	21,100	2,898.000	61,147,800		
ＵＢＥ	35,100	1,930.000	67,743,000		
積水樹脂	11,300	1,730.000	19,549,000		
タキロンシーアイ	17,600	545.000	9,592,000		
旭有機材	4,900	1,910.000	9,359,000		
ニチバン	5,600	1,684.000	9,430,400		
リケンテクノス	20,300	442.000	8,972,600		
大倉工業	4,500	1,774.000	7,983,000		
群栄化学工業	2,300	2,769.000	6,368,700		
ミライアル	3,100	1,640.000	5,084,000		
ダイキョーニシカワ	17,700	517.000	9,150,900		
森六ホールディングス	5,000	1,759.000	8,795,000		
恵和	2,100	5,300.000	11,130,000		
日本化薬	59,800	1,119.000	66,916,200		
カーリットホールディングス	9,600	626.000	6,009,600		
日本精化	6,300	2,188.000	13,784,400		
扶桑化学工業	6,700	3,990.000	26,733,000		
トリケミカル研究所	7,700	2,773.000	21,352,100		
ＡＤＥＫＡ	34,400	2,624.000	90,265,600		
日油	25,600	4,775.000	122,240,000		
新日本理化	20,100	231.000	4,643,100		
ハリマ化成グループ	8,000	791.000	6,328,000		
花王	169,800	4,965.000	843,057,000		
第一工業製薬	3,100	2,598.000	8,053,800		
石原ケミカル	5,000	1,266.000	6,330,000		
ニイタカ	2,400	2,426.000	5,822,400		
三洋化成工業	4,300	4,970.000	21,371,000		
大日本塗料	12,000	768.000	9,216,000		
日本ペイントホールディングス	282,400	1,089.000	307,533,600		
関西ペイント	78,000	1,924.000	150,072,000		
中国塗料	18,800	911.000	17,126,800		
日本特殊塗料	7,600	809.000	6,148,400		

藤倉化成	12,900	446.000	5,753,400		
太陽ホールディングス	11,000	3,215.000	35,365,000		
ＤＩＣ	31,700	2,389.000	75,731,300		
サカタインクス	15,100	914.000	13,801,400		
東洋インキＳＣホールディングス	14,800	1,893.000	28,016,400		
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	8,700	808.000	7,029,600		
富士フイルムホールディングス	134,900	7,324.000	988,007,600		
資生堂	142,900	6,161.000	880,406,900		
ライオン	93,200	1,316.000	122,651,200		
高砂香料工業	5,400	2,586.000	13,964,400		
マンダム	16,600	1,307.000	21,696,200		
ミルボン	9,600	5,340.000	51,264,000		
ファンケル	31,100	2,616.000	81,357,600		
コーセー	14,500	12,930.000	187,485,000		
コタ	6,490	1,419.000	9,209,310		
ポーラ・オルビスホールディングス	33,000	1,532.000	50,556,000		
ノエビアホールディングス	6,600	4,990.000	32,934,000		
エステー	6,100	1,511.000	9,217,100		
コニシ	12,900	1,516.000	19,556,400		
長谷川香料	13,300	2,560.000	34,048,000		
小林製薬	21,500	9,360.000	201,240,000		
荒川化学工業	7,900	1,033.000	8,160,700		
メック	5,800	2,925.000	16,965,000		
タカラバイオ	20,100	2,270.000	45,627,000		
ＪＣＵ	8,500	3,655.000	31,067,500		
ＯＡＴアグリオ	4,200	1,080.000	4,536,000		
デクセリアルズ	20,000	3,125.000	62,500,000		
アース製薬	6,300	5,410.000	34,083,000		
北興化学工業	8,100	1,018.000	8,245,800		
大成ラミック	3,500	2,547.000	8,914,500		
クミアイ化学工業	29,000	891.000	25,839,000		
日本農薬	16,600	603.000	10,009,800		
アキレス	6,800	1,309.000	8,901,200		
有沢製作所	12,300	899.000	11,057,700		
日東電工	46,200	8,390.000	387,618,000		
レック	11,600	864.000	10,022,400		
藤森工業	6,700	3,520.000	23,584,000		
前澤化成工業	6,900	1,261.000	8,700,900		
未来工業	4,000	1,482.000	5,928,000		
ＪＳＰ	5,400	1,485.000	8,019,000		
エフピコ	14,600	2,773.000	40,485,800		
天馬	6,100	2,201.000	13,426,100		
信越ポリマー	13,700	1,080.000	14,796,000		
東リ	29,700	224.000	6,652,800		
ニフコ	25,700	2,581.000	66,331,700		
バルカー	6,200	2,540.000	15,748,000		
ユニ・チャーム	147,700	4,362.000	644,267,400		
協和キリン	89,600	2,882.000	258,227,200		

武田薬品工業	602,300	3,737.000	2,250,795,100		
アステラス製薬	664,300	2,076.500	1,379,418,950		
住友ファーマ	47,500	1,188.000	56,430,000		
塩野義製薬	96,300	6,611.000	636,639,300		
日本新薬	20,100	9,010.000	181,101,000		
中外製薬	239,600	4,256.000	1,019,737,600		
科研製薬	12,300	3,895.000	47,908,500		
エーザイ	91,600	5,745.000	526,242,000		
ロート製薬	39,300	3,475.000	136,567,500		
小野薬品工業	175,800	3,183.000	559,571,400		
久光製薬	20,300	3,505.000	71,151,500		
持田製薬	9,900	3,720.000	36,828,000		
参天製薬	142,700	1,099.000	156,827,300		
扶桑薬品工業	3,600	2,110.000	7,596,000		
日本ケミファ	2,500	1,999.000	4,997,500		
ツムラ	23,900	3,230.000	77,197,000		
日医工	25,100	764.000	19,176,400		
キッセイ薬品工業	13,300	2,464.000	32,771,200		
生化学工業	13,400	865.000	11,591,000		
栄研化学	13,300	1,712.000	22,769,600		
鳥居薬品	4,300	3,130.000	13,459,000		
ＪＣＲファーマ	22,000	2,319.000	51,018,000		
東和薬品	10,900	2,659.000	28,983,100		
富士製薬工業	6,800	965.000	6,562,000		
ゼリア新薬工業	13,900	1,958.000	27,216,200		
第一三共	602,300	2,926.000	1,762,329,800		
キョーリン製薬ホールディングス	15,000	1,815.000	27,225,000		
大幸薬品	13,400	613.000	8,214,200		
ダイト	5,100	2,818.000	14,371,800		
大塚ホールディングス	159,200	4,199.000	668,480,800		
大正製薬ホールディングス	18,100	5,080.000	91,948,000		
ペプチドリーム	40,600	2,246.000	91,187,600		
あすか製薬ホールディングス	9,500	1,266.000	12,027,000		
サワイグループホールディングス	16,800	4,320.000	72,576,000		
日本コークス工業	75,000	143.000	10,725,000		
ニチレキ	10,500	1,170.000	12,285,000		
ユシロ化学工業	7,200	1,009.000	7,264,800		
富士石油	18,000	308.000	5,544,000		
ＭＯＲＥＳＣＯ	5,800	1,138.000	6,600,400		
出光興産	84,500	3,390.000	286,455,000		
ＥＮＥＯＳホールディングス	1,148,900	447.600	514,247,640		
コスモエネルギーホールディングス	22,100	3,210.000	70,941,000		
横浜ゴム	43,500	1,681.000	73,123,500		
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	40,200	1,419.000	57,043,800		
ブリヂストン	220,700	4,577.000	1,010,143,900		
住友ゴム工業	68,800	1,094.000	75,267,200		
藤倉コンポジット	7,400	726.000	5,372,400		
オカモト	4,700	3,910.000	18,377,000		

ニッタ	7,700	2,711.000	20,874,700		
住友理工	16,600	554.000	9,196,400		
三ツ星ベルト	9,400	1,941.000	18,245,400		
バンドー化学	13,500	833.000	11,245,500		
日東紡績	11,700	2,619.000	30,642,300		
ＡＧＣ	70,200	4,825.000	338,715,000		
日本電気硝子	31,000	2,579.000	79,949,000		
オハラ	4,300	1,121.000	4,820,300		
住友大阪セメント	14,600	3,165.000	46,209,000		
太平洋セメント	43,600	1,948.000	84,932,800		
日本ヒューム	12,500	680.000	8,500,000		
日本コンクリート工業	22,900	303.000	6,938,700		
三谷セキサン	3,700	5,700.000	21,090,000		
アジアパイルホールディングス	17,100	420.000	7,182,000		
東海カーボン	64,500	1,088.000	70,176,000		
日本カーボン	4,000	4,150.000	16,600,000		
東洋炭素	5,100	2,927.000	14,927,700		
ノリタケカンパニーリミテド	4,400	4,100.000	18,040,000		
ＴＯＴＯ	54,700	4,470.000	244,509,000		
日本碍子	82,500	1,661.000	137,032,500		
日本特殊陶業	58,300	1,875.000	109,312,500		
ＭＡＲＵＷＡ	2,600	14,250.000	37,050,000		
品川リフラクトリーズ	2,000	3,590.000	7,180,000		
黒崎播磨	1,600	4,035.000	6,456,000		
ヨータイ	5,800	1,255.000	7,279,000		
東京窯業	16,100	288.000	4,636,800		
フジミインコーポレーテッド	6,100	5,850.000	35,685,000		
ニチアス	17,500	2,390.000	41,825,000		
ニチハ	10,700	2,322.000	24,845,400		
日本製鉄	339,000	2,077.500	704,272,500		
神戸製鋼所	139,700	558.000	77,952,600		
中山製鋼所	14,900	426.000	6,347,400		
合同製鐵	5,500	1,335.000	7,342,500		
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	204,000	1,651.000	336,804,000		
東京製鐵	25,700	1,123.000	28,861,100		
共英製鋼	9,100	1,336.000	12,157,600		
大和工業	14,500	3,605.000	52,272,500		
東京鐵鋼	4,900	1,289.000	6,316,100		
大阪製鐵	4,800	1,552.000	7,449,600		
淀川製鋼所	9,700	2,656.000	25,763,200		
丸一鋼管	24,000	2,778.000	66,672,000		
モリ工業	2,800	2,518.000	7,050,400		
大同特殊鋼	12,500	3,530.000	44,125,000		
日本冶金工業	5,700	2,572.000	14,660,400		
山陽特殊製鋼	7,900	1,973.000	15,586,700		
愛知製鋼	4,800	2,325.000	11,160,000		
日立金属	81,600	1,950.000	159,120,000		
大平洋金属	4,900	3,630.000	17,787,000		

新日本電工	49,600	325.000	16,120,000		
栗本鐵工所	5,000	1,577.000	7,885,000		
三菱製鋼	6,300	1,079.000	6,797,700		
日本精線	1,500	4,200.000	6,300,000		
エンビプロ・ホールディングス	2,900	2,148.000	6,229,200		
大紀アルミニウム工業所	11,300	1,535.000	17,345,500		
日本軽金属ホールディングス	19,300	1,655.000	31,941,500		
三井金属鉱業	20,200	3,340.000	67,468,000		
東邦亜鉛	4,600	2,838.000	13,054,800		
三菱マテリアル	50,000	2,075.000	103,750,000		
住友金属鉱山	96,900	6,171.000	597,969,900		
ＤＯＷＡホールディングス	20,500	5,760.000	118,080,000		
古河機械金属	12,500	1,270.000	15,875,000		
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,000	1,323.000	14,553,000		
東邦チタニウム	14,400	1,491.000	21,470,400		
ＵＡＣＪ	11,300	2,225.000	25,142,500		
ＣＫサンエツ	1,900	4,040.000	7,676,000		
古河電気工業	23,700	2,083.000	49,367,100		
住友電気工業	283,500	1,379.500	391,088,250		
フジクラ	84,100	556.000	46,759,600		
昭和電線ホールディングス	6,900	1,735.000	11,971,500		
タツタ電線	15,600	450.000	7,020,000		
平河ヒューテック	5,400	1,084.000	5,853,600		
リョービ	10,200	1,055.000	10,761,000		
アサヒホールディングス	30,200	2,203.000	66,530,600		
宮地エンジニアリンググループ	2,700	3,485.000	9,409,500		
トーカロ	19,400	1,275.000	24,735,000		
アルファ	5,600	954.000	5,342,400		
ＳＵＭＣＯ	116,600	1,870.000	218,042,000		
川田テクノロジーズ	2,100	3,550.000	7,455,000		
ＲＳ　ＴＥＣＨＮＯＬＯＧＩＥＳ	2,500	6,010.000	15,025,000		
東洋製罐グループホールディングス	48,600	1,339.000	65,075,400		
ホッカンホールディングス	6,300	1,228.000	7,736,400		
横河ブリッジホールディングス	12,900	1,902.000	24,535,800		
駒井ハルテック	2,100	1,980.000	4,158,000		
三和ホールディングス	71,500	1,129.000	80,723,500		
文化シヤッター	24,200	948.000	22,941,600		
三協立山	12,000	591.000	7,092,000		
アルインコ	8,600	853.000	7,335,800		
ＬＩＸＩＬ	119,200	2,095.000	249,724,000		
ノーリツ	14,600	1,451.000	21,184,600		
長府製作所	8,400	1,910.000	16,044,000		
リンナイ	14,300	8,200.000	117,260,000		
日東精工	13,000	483.000	6,279,000		
岡部	17,100	663.000	11,337,300		
ジーテクト	9,300	1,218.000	11,327,400		
東プレ	14,200	1,055.000	14,981,000		
高周波熱錬	15,700	573.000	8,996,100		

東京製綱	6,500	877.000	5,700,500		
サンコール	9,900	493.000	4,880,700		
パイオラックス	11,000	1,464.000	16,104,000		
エイチワン	10,100	586.000	5,918,600		
日本発条	70,200	828.000	58,125,600		
立川ブラインド工業	5,000	1,070.000	5,350,000		
三益半導体工業	5,800	2,323.000	13,473,400		
日本製鋼所	23,100	3,685.000	85,123,500		
三浦工業	32,900	2,689.000	88,468,100		
タクマ	25,700	1,449.000	37,239,300		
ツガミ	17,400	1,227.000	21,349,800		
オークマ	8,700	4,675.000	40,672,500		
芝浦機械	8,600	3,210.000	27,606,000		
アマダ	118,500	984.000	116,604,000		
アイダエンジニアリング	19,700	963.000	18,971,100		
ＦＵＪＩ	34,700	2,130.000	73,911,000		
牧野フライス製作所	8,100	3,810.000	30,861,000		
オーエスジー	35,400	1,607.000	56,887,800		
旭ダイヤモンド工業	21,700	565.000	12,260,500		
ＤＭＧ森精機	44,700	1,520.000	67,944,000		
ソディック	17,300	719.000	12,438,700		
ディスコ	11,200	30,450.000	341,040,000		
日東工器	5,300	1,495.000	7,923,500		
日進工具	6,500	1,426.000	9,269,000		
石川製作所	2,500	1,431.000	3,577,500		
島精機製作所	11,400	1,831.000	20,873,400		
オプトラン	9,700	2,033.000	19,720,100		
ＮＣホールディングス	3,000	1,595.000	4,785,000		
フリュー	7,400	1,025.000	7,585,000		
ヤマシンフィルタ	18,900	340.000	6,426,000		
日阪製作所	11,600	768.000	8,908,800		
やまびこ	14,700	1,361.000	20,006,700		
野村マイクロ・サイエンス	2,200	3,840.000	8,448,000		
平田機工	3,600	4,895.000	17,622,000		
マルマエ	3,500	2,093.000	7,325,500		
タツモ	4,500	1,542.000	6,939,000		
ナブテスコ	43,200	3,060.000	132,192,000		
三井海洋開発	8,800	1,226.000	10,788,800		
レオン自動機	9,400	1,030.000	9,682,000		
ＳＭＣ	22,500	64,940.000	1,461,150,000		
ホソカワミクロン	5,400	2,510.000	13,554,000		
ユニオンツール	3,000	3,680.000	11,040,000		
オイレス工業	10,500	1,474.000	15,477,000		
日精エー・エス・ビー機械	2,900	2,912.000	8,444,800		
サトーホールディングス	10,100	1,695.000	17,119,500		
技研製作所	6,700	3,530.000	23,651,000		
日本エアーテック	4,900	1,042.000	5,105,800		
日精樹脂工業	6,900	965.000	6,658,500		

ワイエイシイホールディングス	3,900	1,631.000	6,360,900		
小松製作所	347,500	2,874.500	998,888,750		
住友重機械工業	43,600	2,651.000	115,583,600		
日立建機	30,700	3,035.000	93,174,500		
日工	14,300	605.000	8,651,500		
巴工業	3,800	2,324.000	8,831,200		
井関農機	7,900	1,244.000	9,827,600		
ＴＯＷＡ	6,700	2,226.000	14,914,200		
北川鉄工所	4,900	1,277.000	6,257,300		
ローツェ	3,800	13,430.000	51,034,000		
クボタ	371,200	2,186.500	811,628,800		
荏原実業	4,000	2,334.000	9,336,000		
三菱化工機	3,200	1,978.000	6,329,600		
月島機械	14,300	1,038.000	14,843,400		
帝国電機製作所	6,200	1,555.000	9,641,000		
新東工業	18,900	672.000	12,700,800		
澁谷工業	6,700	2,328.000	15,597,600		
アイチコーポレーション	12,200	887.000	10,821,400		
小森コーポレーション	21,000	692.000	14,532,000		
鶴見製作所	6,600	1,785.000	11,781,000		
荏原製作所	31,400	6,090.000	191,226,000		
酉島製作所	10,000	1,142.000	11,420,000		
北越工業	9,300	829.000	7,709,700		
ダイキン工業	97,700	20,405.000	1,993,568,500		
オルガノ	2,100	9,570.000	20,097,000		
トーヨーカネツ	3,500	2,457.000	8,599,500		
栗田工業	41,500	4,300.000	178,450,000		
椿本チエイン	9,600	2,898.000	27,820,800		
大同工業	5,300	892.000	4,727,600		
木村化工機	7,500	815.000	6,112,500		
アネスト岩田	13,800	812.000	11,205,600		
ダイフク	42,100	7,960.000	335,116,000		
サムコ	2,400	2,541.000	6,098,400		
タダノ	41,200	939.000	38,686,800		
フジテック	28,600	3,015.000	86,229,000		
ＣＫＤ	22,300	1,713.000	38,199,900		
キトー	7,200	1,667.000	12,002,400		
平和	21,500	1,861.000	40,011,500		
理想科学工業	6,700	2,208.000	14,793,600		
ＳＡＮＫＹＯ	16,700	3,600.000	60,120,000		
日本金銭機械	10,800	678.000	7,322,400		
マースグループホールディングス	6,400	1,663.000	10,643,200		
フクシマガリレイ	5,300	3,660.000	19,398,000		
ダイコク電機	5,600	1,218.000	6,820,800		
竹内製作所	11,400	2,287.000	26,071,800		
アマノ	20,400	2,028.000	41,371,200		
ＪＵＫＩ	11,800	799.000	9,428,200		
ジャノメ	8,100	669.000	5,418,900		

マックス	10,300	1,577.000	16,243,100		
グローリー	19,800	1,994.000	39,481,200		
新晃工業	7,300	1,593.000	11,628,900		
大和冷機工業	11,000	1,067.000	11,737,000		
セガサミーホールディングス	76,200	2,247.000	171,221,400		
日本ピストンリング	4,400	1,252.000	5,508,800		
リケン	3,800	2,320.000	8,816,000		
ＴＰＲ	10,200	1,230.000	12,546,000		
ツバキ・ナカシマ	17,100	934.000	15,971,400		
ホシザキ	22,400	8,390.000	187,936,000		
大豊工業	8,200	668.000	5,477,600		
日本精工	144,000	703.000	101,232,000		
ＮＴＮ	163,900	199.000	32,616,100		
ジェイテクト	72,800	882.000	64,209,600		
不二越	6,300	3,745.000	23,593,500		
日本トムソン	22,700	521.000	11,826,700		
ＴＨＫ	43,300	2,565.000	111,064,500		
ユーシン精機	9,000	638.000	5,742,000		
前澤給装工業	7,800	929.000	7,246,200		
イーグル工業	10,500	917.000	9,628,500		
日本ピラー工業	7,700	2,783.000	21,429,100		
キッツ	26,500	665.000	17,622,500		
マキタ	93,300	3,754.000	350,248,200		
日立造船	64,800	692.000	44,841,600		
三菱重工業	120,200	4,210.000	506,042,000		
ＩＨＩ	47,800	2,861.000	136,755,800		
スター精密	11,800	1,434.000	16,921,200		
日清紡ホールディングス	47,100	1,009.000	47,523,900		
イビデン	40,200	5,430.000	218,286,000		
コニカミノルタ	168,500	489.000	82,396,500		
ブラザー工業	93,500	2,173.000	203,175,500		
ミネベアミツミ	131,600	2,470.000	325,052,000		
日立製作所	368,800	5,818.000	2,145,678,400		
東芝	133,900	5,000.000	669,500,000		
三菱電機	766,800	1,352.500	1,037,097,000		
富士電機	46,100	5,500.000	253,550,000		
安川電機	82,400	4,525.000	372,860,000		
シンフォニア　テクノロジー	10,400	1,266.000	13,166,400		
明電舎	13,100	2,416.000	31,649,600		
オリジン	4,700	1,391.000	6,537,700		
山洋電気	3,500	4,605.000	16,117,500		
デンヨー	7,600	1,588.000	12,068,800		
ＰＨＣホールディングス	9,000	1,865.000	16,785,000		
東芝テック	8,300	4,450.000	36,935,000		
芝浦メカトロニクス	1,400	7,480.000	10,472,000		
マブチモーター	17,800	3,585.000	63,813,000		
日本電産	198,600	8,760.000	1,739,736,000		
トレックス・セミコンダクター	4,200	2,304.000	9,676,800		

東光高岳	5,200	1,429.000	7,430,800		
ダイヘン	8,200	3,700.000	30,340,000		
ヤーマン	13,500	1,274.000	17,199,000		
ＪＶＣケンウッド	67,700	164.000	11,102,800		
ミマキエンジニアリング	9,300	645.000	5,998,500		
Ｉ－ＰＥＸ	4,300	1,402.000	6,028,600		
日新電機	17,800	1,376.000	24,492,800		
大崎電気工業	19,000	488.000	9,272,000		
オムロン	63,800	7,718.000	492,408,400		
日東工業	10,100	1,502.000	15,170,200		
ＩＤＥＣ	9,800	2,310.000	22,638,000		
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	25,200	2,188.000	55,137,600		
メルコホールディングス	2,000	3,780.000	7,560,000		
日本電気	97,400	5,190.000	505,506,000		
富士通	69,000	19,070.000	1,315,830,000		
沖電気工業	31,300	828.000	25,916,400		
電気興業	4,700	2,333.000	10,965,100		
サンケン電気	7,300	4,415.000	32,229,500		
アイホン	5,000	1,965.000	9,825,000		
ルネサスエレクトロニクス	416,000	1,289.000	536,224,000		
セイコーエプソン	95,100	1,763.000	167,661,300		
ワコム	59,400	951.000	56,489,400		
アルバック	15,300	5,410.000	82,773,000		
アクセル	4,300	986.000	4,239,800		
ＥＩＺＯ	6,000	3,460.000	20,760,000		
日本信号	20,100	884.000	17,768,400		
京三製作所	20,100	421.000	8,462,100		
能美防災	10,300	1,897.000	19,539,100		
ホーチキ	6,900	1,180.000	8,142,000		
エレコム	17,600	1,493.000	26,276,800		
パナソニック　ホールディングス	818,100	1,129.500	924,043,950		
シャープ	87,300	1,089.000	95,069,700		
アンリツ	49,800	1,611.000	80,227,800		
富士通ゼネラル	21,300	2,274.000	48,436,200		
ソニーグループ	480,200	11,500.000	5,522,300,000		
ＴＤＫ	110,900	4,075.000	451,917,500		
帝国通信工業	5,000	1,420.000	7,100,000		
タムラ製作所	30,100	591.000	17,789,100		
アルプスアルパイン	68,600	1,170.000	80,262,000		
日本電波工業	7,700	1,230.000	9,471,000		
メイコー	6,200	3,825.000	23,715,000		
日本トリム	2,200	2,503.000	5,506,600		
ローランド　ディー．ジー．	4,800	3,140.000	15,072,000		
フォスター電機	10,300	676.000	6,962,800		
ＳＭＫ	2,600	2,145.000	5,577,000		
ヨコオ	5,700	2,259.000	12,876,300		
ホシデン	18,300	1,162.000	21,264,600		
ヒロセ電機	11,800	16,440.000	193,992,000		

日本航空電子工業	17,500	1,938.000	33,915,000		
ＴＯＡ	10,500	664.000	6,972,000		
マクセル	15,400	1,167.000	17,971,800		
古野電気	10,400	1,002.000	10,420,800		
ユニデンホールディングス	2,200	3,480.000	7,656,000		
スミダコーポレーション	8,100	826.000	6,690,600		
アイコム	3,700	2,452.000	9,072,400		
リオン	3,600	2,439.000	8,780,400		
横河電機	76,700	2,110.000	161,837,000		
新電元工業	3,200	2,871.000	9,187,200		
アズビル	45,000	3,825.000	172,125,000		
東亜ディーケーケー	6,100	916.000	5,587,600		
日本光電工業	32,000	2,922.000	93,504,000		
共和電業	17,600	355.000	6,248,000		
日本電子材料	4,400	2,032.000	8,940,800		
堀場製作所	14,200	5,900.000	83,780,000		
アドバンテスト	56,900	8,520.000	484,788,000		
エスペック	6,500	1,792.000	11,648,000		
キーエンス	69,500	56,020.000	3,893,390,000		
日置電機	3,700	7,330.000	27,121,000		
シスメックス	64,800	9,093.000	589,226,400		
日本マイクロニクス	13,500	1,557.000	21,019,500		
メガチップス	7,200	3,520.000	25,344,000		
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	3,900	2,842.000	11,083,800		
コーセル	11,000	762.000	8,382,000		
イリソ電子工業	6,600	3,125.000	20,625,000		
オプテックスグループ	12,900	1,670.000	21,543,000		
千代田インテグレ	4,200	2,103.000	8,832,600		
レーザーテック	33,700	18,710.000	630,527,000		
スタンレー電気	53,400	2,093.000	111,766,200		
岩崎電気	3,600	2,309.000	8,312,400		
ウシオ電機	39,700	1,619.000	64,274,300		
日本セラミック	7,400	2,349.000	17,382,600		
遠藤照明	5,300	914.000	4,844,200		
古河電池	6,000	1,213.000	7,278,000		
山一電機	6,100	1,649.000	10,058,900		
図研	5,200	3,035.000	15,782,000		
日本電子	16,000	5,840.000	93,440,000		
カシオ計算機	55,900	1,335.000	74,626,500		
ファナック	67,300	20,620.000	1,387,726,000		
日本シイエムケイ	17,100	552.000	9,439,200		
エンプラス	2,400	2,768.000	6,643,200		
大真空	11,000	1,115.000	12,265,000		
ローム	34,300	8,720.000	299,096,000		
浜松ホトニクス	54,900	5,890.000	323,361,000		
三井ハイテック	7,500	11,800.000	88,500,000		
新光電気工業	22,500	5,420.000	121,950,000		
京セラ	107,900	6,670.000	719,693,000		

太陽誘電	37,100	5,030.000	186,613,000		
村田製作所	225,200	7,781.000	1,752,281,200		
双葉電子工業	17,500	647.000	11,322,500		
北陸電気工業	4,700	1,116.000	5,245,200		
ニチコン	24,200	1,106.000	26,765,200		
日本ケミコン	7,700	1,753.000	13,498,100		
ＫＯＡ	11,800	1,319.000	15,564,200		
市光工業	11,300	359.000	4,056,700		
小糸製作所	41,900	4,485.000	187,921,500		
ミツバ	16,500	339.000	5,593,500		
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	13,300	10,770.000	143,241,000		
キヤノン電子	7,800	1,546.000	12,058,800		
キヤノン	380,800	2,989.000	1,138,211,200		
リコー	213,200	961.000	204,885,200		
象印マホービン	21,000	1,361.000	28,581,000		
東京エレクトロン	48,600	55,690.000	2,706,534,000		
トヨタ紡織	31,300	1,850.000	57,905,000		
ユニプレス	13,800	708.000	9,770,400		
豊田自動織機	61,800	7,620.000	470,916,000		
モリタホールディングス	13,100	1,218.000	15,955,800		
三櫻工業	11,300	687.000	7,763,100		
デンソー	168,900	7,125.000	1,203,412,500		
東海理化電機製作所	19,300	1,406.000	27,135,800		
川崎重工業	55,900	2,184.000	122,085,600		
日本車輌製造	3,700	2,094.000	7,747,800		
三菱ロジスネクスト	10,900	794.000	8,654,600		
日産自動車	905,100	504.000	456,170,400		
いすゞ自動車	240,200	1,490.000	357,898,000		
トヨタ自動車	3,883,000	2,119.500	8,230,018,500		
日野自動車	96,000	674.000	64,704,000		
三菱自動車工業	284,500	307.000	87,341,500		
武蔵精密工業	17,100	1,282.000	21,922,200		
日産車体	13,500	528.000	7,128,000		
新明和工業	21,700	885.000	19,204,500		
極東開発工業	14,300	1,280.000	18,304,000		
トピー工業	8,300	1,015.000	8,424,500		
ティラド	2,700	2,238.000	6,042,600		
曙ブレーキ工業	50,300	147.000	7,394,100		
タチエス	14,400	964.000	13,881,600		
ＮＯＫ	37,800	1,062.000	40,143,600		
フタバ産業	21,800	329.000	7,172,200		
ＫＹＢ	7,800	2,783.000	21,707,400		
大同メタル工業	18,700	553.000	10,341,100		
プレス工業	39,700	361.000	14,331,700		
ミクニ	12,800	370.000	4,736,000		
太平洋工業	16,300	896.000	14,604,800		
アイシン	55,800	3,795.000	211,761,000		
マツダ	240,500	880.000	211,640,000		

本田技研工業	603,900	3,261.000	1,969,317,900		
スズキ	175,500	3,853.000	676,201,500		
ＳＵＢＡＲＵ	219,900	1,830.000	402,417,000		
安永	5,900	751.000	4,430,900		
ヤマハ発動機	99,600	2,599.000	258,860,400		
ＴＢＫ	17,300	348.000	6,020,400		
エクセディ	11,400	1,476.000	16,826,400		
豊田合成	24,900	1,790.000	44,571,000		
愛三工業	13,700	663.000	9,083,100		
ヨロズ	9,300	804.000	7,477,200		
エフ・シー・シー	12,300	1,246.000	15,325,800		
シマノ	30,700	25,310.000	777,017,000		
テイ・エス　テック	32,700	1,314.000	42,967,800		
ジャムコ	5,500	778.000	4,279,000		
テルモ	217,100	3,892.000	844,953,200		
日機装	23,200	827.000	19,186,400		
日本エム・ディ・エム	5,100	1,641.000	8,369,100		
島津製作所	98,400	4,135.000	406,884,000		
ＪＭＳ	9,600	594.000	5,702,400		
長野計器	6,200	1,128.000	6,993,600		
ブイ・テクノロジー	3,500	3,065.000	10,727,500		
東京計器	6,800	1,146.000	7,792,800		
インターアクション	4,100	1,832.000	7,511,200		
東京精密	12,800	4,385.000	56,128,000		
マニー	31,300	1,616.000	50,580,800		
ニコン	117,200	1,367.000	160,212,400		
トプコン	36,500	1,493.000	54,494,500		
オリンパス	402,400	2,456.000	988,294,400		
理研計器	6,200	4,520.000	28,024,000		
タムロン	5,900	2,273.000	13,410,700		
ＨＯＹＡ	149,600	12,955.000	1,938,068,000		
ノーリツ鋼機	7,100	2,176.000	15,449,600		
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	7,600	875.000	6,650,000		
朝日インテック	84,300	2,625.000	221,287,500		
シチズン時計	88,800	476.000	42,268,800		
リズム	3,800	1,451.000	5,513,800		
メニコン	25,700	2,864.000	73,604,800		
松風	4,100	1,605.000	6,580,500		
セイコーホールディングス	10,700	2,096.000	22,427,200		
ニプロ	58,200	1,015.000	59,073,000		
スノーピーク	9,900	3,160.000	31,284,000		
パラマウントベッドホールディングス	14,700	2,032.000	29,870,400		
トランザクション	5,700	998.000	5,688,600		
ニホンフラッシュ	7,600	975.000	7,410,000		
前田工繊	8,500	2,984.000	25,364,000		
永大産業	20,600	286.000	5,891,600		
アートネイチャー	9,300	703.000	6,537,900		
バンダイナムコホールディングス	68,600	9,081.000	622,956,600		

ＳＨＯＥＩ	7,200	4,720.000	33,984,000		
フランスベッドホールディングス	12,700	871.000	11,061,700		
パイロットコーポレーション	13,100	5,040.000	66,024,000		
萩原工業	6,600	1,072.000	7,075,200		
フジシールインターナショナル	18,700	1,637.000	30,611,900		
タカラトミー	31,800	1,187.000	37,746,600		
広済堂ホールディングス	6,500	829.000	5,388,500		
プロネクサス	7,800	1,042.000	8,127,600		
大建工業	4,900	2,065.000	10,118,500		
凸版印刷	116,100	2,139.000	248,337,900		
大日本印刷	90,300	2,704.000	244,171,200		
共同印刷	3,000	2,733.000	8,199,000		
ＮＩＳＳＨＡ	15,900	1,419.000	22,562,100		
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	5,700	1,883.000	10,733,100		
アシックス	67,900	2,092.000	142,046,800		
ローランド	5,500	4,280.000	23,540,000		
ヤマハ	44,400	5,100.000	226,440,000		
河合楽器製作所	2,500	2,978.000	7,445,000		
ピジョン	45,600	2,147.000	97,903,200		
キングジム	9,600	929.000	8,918,400		
リンテック	16,700	2,407.000	40,196,900		
イトーキ	20,200	339.000	6,847,800		
任天堂	43,300	64,540.000	2,794,582,000		
三菱鉛筆	12,700	1,249.000	15,862,300		
タカラスタンダード	15,700	1,284.000	20,158,800		
コクヨ	37,400	1,638.000	61,261,200		
ナカバヤシ	11,400	485.000	5,529,000		
グローブライド	6,900	2,668.000	18,409,200		
オカムラ	26,300	1,164.000	30,613,200		
美津濃	7,800	2,042.000	15,927,600		
東京電力ホールディングス	573,900	435.000	249,646,500		
中部電力	232,900	1,316.000	306,496,400		
関西電力	289,200	1,177.000	340,388,400		
中国電力	118,400	869.000	102,889,600		
北陸電力	72,100	542.000	39,078,200		
東北電力	178,000	725.000	129,050,000		
四国電力	69,300	768.000	53,222,400		
九州電力	156,300	828.000	129,416,400		
北海道電力	67,700	488.000	33,037,600		
沖縄電力	16,300	1,329.000	21,662,700		
電源開発	65,400	1,749.000	114,384,600		
エフオン	7,600	582.000	4,423,200		
イーレックス	11,600	1,907.000	22,121,200		
レノバ	15,200	1,640.000	24,928,000		
東京瓦斯	146,500	2,249.000	329,478,500		
大阪瓦斯	137,900	2,086.000	287,659,400		
東邦瓦斯	34,900	2,651.000	92,519,900		
北海道瓦斯	5,600	1,471.000	8,237,600		

広島ガス	20,900	321.000	6,708,900		
西部ガスホールディングス	8,900	1,949.000	17,346,100		
静岡ガス	19,700	871.000	17,158,700		
メタウォーター	8,500	1,986.000	16,881,000		
ＳＢＳホールディングス	5,500	3,165.000	17,407,500		
東武鉄道	74,300	2,955.000	219,556,500		
相鉄ホールディングス	25,000	2,222.000	55,550,000		
東急	192,200	1,586.000	304,829,200		
京浜急行電鉄	98,600	1,285.000	126,701,000		
小田急電鉄	113,800	1,990.000	226,462,000		
京王電鉄	39,700	4,760.000	188,972,000		
京成電鉄	53,300	3,355.000	178,821,500		
富士急行	9,200	3,930.000	36,156,000		
新京成電鉄	3,800	2,132.000	8,101,600		
東日本旅客鉄道	134,900	6,899.000	930,675,100		
西日本旅客鉄道	92,900	4,896.000	454,838,400		
東海旅客鉄道	63,800	15,885.000	1,013,463,000		
西武ホールディングス	100,200	1,257.000	125,951,400		
鴻池運輸	12,300	1,087.000	13,370,100		
西日本鉄道	21,500	2,592.000	55,728,000		
ハマキョウレックス	5,400	2,764.000	14,925,600		
サカイ引越センター	3,400	4,030.000	13,702,000		
近鉄グループホールディングス	72,100	3,525.000	254,152,500		
阪急阪神ホールディングス	90,200	3,410.000	307,582,000		
南海電気鉄道	32,600	2,303.000	75,077,800		
京阪ホールディングス	32,400	2,673.000	86,605,200		
神戸電鉄	2,800	3,190.000	8,932,000		
名古屋鉄道	59,800	2,093.000	125,161,400		
山陽電気鉄道	6,700	2,051.000	13,741,700		
アルプス物流	5,700	1,020.000	5,814,000		
ヤマトホールディングス	101,700	2,362.000	240,215,400		
山九	19,000	3,690.000	70,110,000		
丸全昭和運輸	6,000	3,060.000	18,360,000		
センコーグループホールディングス	35,000	850.000	29,750,000		
トナミホールディングス	2,000	3,540.000	7,080,000		
ニッコンホールディングス	24,600	1,895.000	46,617,000		
福山通運	11,700	3,400.000	39,780,000		
セイノーホールディングス	49,200	1,018.000	50,085,600		
神奈川中央交通	2,600	3,270.000	8,502,000		
日立物流	14,000	6,520.000	91,280,000		
丸和運輸機関	15,400	1,372.000	21,128,800		
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	7,800	1,092.000	8,517,600		
九州旅客鉄道	56,300	2,514.000	141,538,200		
ＳＧホールディングス	137,000	2,187.000	299,619,000		
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	24,900	7,310.000	182,019,000		
日本郵船	60,600	9,120.000	552,672,000		
商船三井	120,300	2,930.000	352,479,000		

川崎汽船	22,300	6,890.000	153,647,000		
ＮＳユナイテッド海運	4,100	3,770.000	15,457,000		
明治海運	10,400	748.000	7,779,200		
飯野海運	35,200	772.000	27,174,400		
乾汽船	5,500	1,669.000	9,179,500		
日本航空	166,300	2,168.000	360,538,400		
ＡＮＡホールディングス	185,300	2,420.000	448,426,000		
トランコム	2,100	6,870.000	14,427,000		
日新	6,400	1,509.000	9,657,600		
三菱倉庫	22,900	2,971.000	68,035,900		
三井倉庫ホールディングス	7,600	2,360.000	17,936,000		
住友倉庫	24,900	2,163.000	53,858,700		
澁澤倉庫	4,900	2,220.000	10,878,000		
東陽倉庫	21,100	310.000	6,541,000		
日本トランスシティ	17,000	560.000	9,520,000		
川西倉庫	3,800	1,109.000	4,214,200		
安田倉庫	8,500	965.000	8,202,500		
東洋埠頭	5,400	1,479.000	7,986,600		
上組	39,200	2,125.000	83,300,000		
近鉄エクスプレス	13,500	3,030.000	40,905,000		
エーアイテイー	5,500	1,474.000	8,107,000		
内外トランスライン	3,500	1,792.000	6,272,000		
日本コンセプト	3,600	1,390.000	5,004,000		
ＮＥＣネッツエスアイ	24,400	1,662.000	40,552,800		
クロスキャット	5,400	1,017.000	5,491,800		
システナ	105,700	415.000	43,865,500		
デジタルアーツ	4,100	7,540.000	30,914,000		
日鉄ソリューションズ	10,700	3,825.000	40,927,500		
コア	4,100	1,569.000	6,432,900		
手間いらず	1,300	4,600.000	5,980,000		
ラクーンホールディングス	7,300	1,161.000	8,475,300		
ソリトンシステムズ	4,900	1,564.000	7,663,600		
ソフトクリエイトホールディングス	3,500	4,595.000	16,082,500		
ＴＩＳ	71,600	2,827.000	202,413,200		
グリー	34,900	1,223.000	42,682,700		
コーエーテクモホールディングス	24,100	4,210.000	101,461,000		
三菱総合研究所	3,100	3,890.000	12,059,000		
ファインデックス	8,000	703.000	5,624,000		
ブレインパッド	7,100	1,309.000	9,293,900		
ＫＬａｂ	16,500	465.000	7,672,500		
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	11,800	1,041.000	12,283,800		
ネクソン	169,900	3,040.000	516,496,000		
エムアップホールディングス	9,400	1,051.000	9,879,400		
エイチーム	7,100	773.000	5,488,300		
エニグモ	9,500	587.000	5,576,500		
コロプラ	25,300	660.000	16,698,000		
ブロードリーフ	38,900	379.000	14,743,100		

デジタルハーツホールディングス	4,200	1,711.000	7,186,200		
システム情報	6,700	927.000	6,210,900		
メディアドゥ	3,000	2,214.000	6,642,000		
じげん	26,100	303.000	7,908,300		
ブイキューブ	8,800	1,043.000	9,178,400		
フィックスターズ	10,400	882.000	9,172,800		
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	3,700	2,508.000	9,279,600		
オプティム	6,700	1,055.000	7,068,500		
セレス	3,300	1,531.000	5,052,300		
ＳＨＩＦＴ	3,800	26,150.000	99,370,000		
ティーガイア	7,000	1,608.000	11,256,000		
テクマトリックス	13,000	2,102.000	27,326,000		
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	19,800	2,590.000	51,282,000		
GMOペイメントゲートウェイ	14,600	11,400.000	166,440,000		
システムリサーチ	3,100	1,876.000	5,815,600		
インターネットイニシアティブ	20,200	4,360.000	88,072,000		
さくらインターネット	11,000	553.000	6,083,000		
GMOグローバルサイン・ホールディングス	1,900	6,380.000	12,122,000		
ＳＲＡホールディングス	4,200	2,769.000	11,629,800		
ｅＢＡＳＥ	11,200	512.000	5,734,400		
アバント	8,700	1,251.000	10,883,700		
アドソル日進	3,800	1,570.000	5,966,000		
フリービット	5,700	866.000	4,936,200		
コムチュア	8,400	2,946.000	24,746,400		
アステリア	6,500	1,063.000	6,909,500		
アイル	4,600	1,442.000	6,633,200		
マークラインズ	4,300	2,735.000	11,760,500		
メディカル・データ・ビジョン	10,500	1,211.000	12,715,500		
ｇｕｍｉ	12,200	604.000	7,368,800		
テラスカイ	3,500	1,584.000	5,544,000		
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,400	1,240.000	5,456,000		
ＰＣＩホールディングス	4,900	1,024.000	5,017,600		
パイプドHD	1,900	2,319.000	4,406,100		
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	1,800	3,335.000	6,003,000		
ラクス	26,200	1,847.000	48,391,400		
ダブルスタンダード	2,700	1,993.000	5,381,100		
オープンドア	5,100	2,010.000	10,251,000		
アカツキ	3,600	3,170.000	11,412,000		
ＵＢＩＣＯＭホールディングス	2,500	2,839.000	7,097,500		
カナミックネットワーク	12,100	536.000	6,485,600		
チェンジ	13,900	1,984.000	27,577,600		
オークネット	5,000	1,636.000	8,180,000		
マクロミル	17,200	1,147.000	19,728,400		
オロ	2,800	2,115.000	5,922,000		
ユーザーローカル	3,400	1,780.000	6,052,000		

マネーフォワード	11,500	5,840.000	67,160,000		
電算システムホールディングス	3,300	2,624.000	8,659,200		
プロトコーポレーション	8,800	1,031.000	9,072,800		
野村総合研究所	145,200	4,130.000	599,676,000		
日本システム技術	2,000	2,614.000	5,228,000		
インテージホールディングス	9,200	1,622.000	14,922,400		
ソースネクスト	39,100	168.000	6,568,800		
インフォコム	8,400	2,140.000	17,976,000		
シンプレクス・ホールディングス	8,800	2,046.000	18,004,800		
ＨＥＲＯＺ	2,600	1,052.000	2,735,200		
ラクスル	8,500	3,060.000	26,010,000		
ＩＰＳ	2,700	2,153.000	5,813,100		
イーソル	6,700	626.000	4,194,200		
アルテリア・ネットワークス	10,100	1,315.000	13,281,500		
ウイングアーク１ｓｔ	5,200	1,430.000	7,436,000		
サーバーワークス	1,600	2,802.000	4,483,200		
Ｓａｎｓａｎ	27,200	1,505.000	40,936,000		
ギフティ	7,900	1,287.000	10,167,300		
ベース	1,600	6,100.000	9,760,000		
ＪＭＤＣ	7,100	6,930.000	49,203,000		
フォーカスシステムズ	6,800	901.000	6,126,800		
クレスコ	6,100	1,929.000	11,766,900		
フジ・メディア・ホールディングス	71,700	1,123.000	80,519,100		
オービック	23,700	18,390.000	435,843,000		
ジャストシステム	10,700	5,490.000	58,743,000		
ＴＤＣソフト	7,800	1,135.000	8,853,000		
Ｚホールディングス	1,082,700	513.800	556,291,260		
トレンドマイクロ	40,200	7,160.000	287,832,000		
日本オラクル	12,200	8,400.000	102,480,000		
アルファシステムズ	2,300	3,640.000	8,372,000		
フューチャー	15,700	1,690.000	26,533,000		
ＣＡＣ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	5,400	1,364.000	7,365,600		
ＳＢテクノロジー	3,700	2,508.000	9,279,600		
オービックビジネスコンサルタント	7,100	4,085.000	29,003,500		
伊藤忠テクノソリューションズ	34,200	3,085.000	105,507,000		
アイティフォー	10,900	783.000	8,534,700		
東計電算	1,200	5,340.000	6,408,000		
大塚商会	40,700	4,175.000	169,922,500		
サイボウズ	10,700	1,349.000	14,434,300		
電通国際情報サービス	10,700	3,860.000	41,302,000		
ＡＣＣＥＳＳ	11,400	574.000	6,543,600		
デジタルガレージ	12,400	4,410.000	54,684,000		
イーエムシステムズ	14,800	849.000	12,565,200		
ウェザーニューズ	2,600	7,970.000	20,722,000		
ＣＩＪ	8,760	766.000	6,710,160		
WOWOW	4,200	1,583.000	6,648,600		
スカラ	9,600	750.000	7,200,000		
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	8,000	749.000	5,992,000		

ネットワンシステムズ	28,800	3,130.000	90,144,000		
アルゴグラフィックス	6,000	3,000.000	18,000,000		
マーベラス	14,300	777.000	11,111,100		
エイベックス	13,500	1,385.000	18,697,500		
ＢＩＰＲＯＧＹ	23,600	3,195.000	75,402,000		
兼松エレクトロニクス	4,100	3,770.000	15,457,000		
都築電気	4,500	1,477.000	6,646,500		
ＴＢＳホールディングス	45,900	1,715.000	78,718,500		
日本テレビホールディングス	63,100	1,237.000	78,054,700		
朝日放送グループホールディングス	9,800	726.000	7,114,800		
テレビ朝日ホールディングス	18,200	1,471.000	26,772,200		
スカパーＪＳＡＴホールディングス	63,100	414.000	26,123,400		
テレビ東京ホールディングス	5,900	1,992.000	11,752,800		
ビジョン	13,600	1,179.000	16,034,400		
ＵＳＥＮ−ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	7,300	2,309.000	16,855,700		
コネクシオ	6,000	1,378.000	8,268,000		
日本通信	68,900	192.000	13,228,800		
日本電信電話	786,800	3,740.000	2,942,632,000		
ＫＤＤＩ	548,400	4,175.000	2,289,570,000		
ソフトバンク	1,138,800	1,465.000	1,668,342,000		
光通信	8,700	14,740.000	128,238,000		
エムティーアイ	10,700	491.000	5,253,700		
ＧＭＯインターネット	26,800	2,538.000	68,018,400		
ファイバーゲート	4,600	1,270.000	5,842,000		
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	41,000	3,160.000	129,560,000		
学研ホールディングス	11,100	929.000	10,311,900		
ゼンリン	13,600	962.000	13,083,200		
アイネット	5,700	1,235.000	7,039,500		
松竹	5,100	11,990.000	61,149,000		
東宝	44,400	4,770.000	211,788,000		
東映	2,500	17,380.000	43,450,000		
エヌ・ティ・ティ・データ	199,500	2,407.000	480,196,500		
ピー・シー・エー	5,100	1,526.000	7,782,600		
ビジネスブレイン太田昭和	3,400	1,362.000	4,630,800		
ＤＴＳ	13,600	2,696.000	36,665,600		
スクウェア・エニックス・ホールディングス	35,100	5,390.000	189,189,000		
シーイーシー	9,000	1,208.000	10,872,000		
カプコン	71,000	3,090.000	219,390,000		
アイ・エス・ビー	4,700	1,102.000	5,179,400		
ジャステック	5,900	1,073.000	6,330,700		
ＳＣＳＫ	51,800	2,095.000	108,521,000		
日本システムウエア	3,300	2,186.000	7,213,800		
アイネス	7,800	1,516.000	11,824,800		
ＴＫＣ	12,400	3,225.000	39,990,000		
富士ソフト	7,900	6,850.000	54,115,000		
ＮＳＤ	23,500	2,263.000	53,180,500		
コナミホールディングス	27,300	8,260.000	225,498,000		

福井コンピュータホールディングス	3,900	3,150.000	12,285,000		
ＪＢＣＣホールディングス	5,900	1,489.000	8,785,100		
ミロク情報サービス	7,900	1,326.000	10,475,400		
ソフトバンクグループ	451,000	5,592.000	2,521,992,000		
高千穂交易	3,900	1,488.000	5,803,200		
伊藤忠食品	2,100	4,945.000	10,384,500		
エレマテック	7,200	1,031.000	7,423,200		
あらた	6,000	3,330.000	19,980,000		
トーメンデバイス	1,200	6,010.000	7,212,000		
東京エレクトロン　デバイス	2,300	4,885.000	11,235,500		
フィールズ	8,000	825.000	6,600,000		
双日	83,100	1,945.000	161,629,500		
アルフレッサ　ホールディングス	84,100	1,714.000	144,147,400		
横浜冷凍	22,900	859.000	19,671,100		
アルコニックス	10,000	1,387.000	13,870,000		
神戸物産	58,700	3,785.000	222,179,500		
あい　ホールディングス	11,000	1,664.000	18,304,000		
ダイワボウホールディングス	36,900	1,598.000	58,966,200		
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	2,041.000	6,531,200		
グリムス	3,700	1,862.000	6,889,400		
バイタルケーエスケー・ホールディングス	15,500	733.000	11,361,500		
八洲電機	8,400	919.000	7,719,600		
レスターホールディングス	7,100	1,960.000	13,916,000		
ジューテックホールディングス	3,000	1,166.000	3,498,000		
ＴＯＫＡＩホールディングス	35,900	863.000	30,981,700		
三洋貿易	8,900	966.000	8,597,400		
ビューティガレージ	1,600	2,811.000	4,497,600		
ウイン・パートナーズ	6,000	984.000	5,904,000		
シップヘルスケアホールディングス	24,700	2,080.000	51,376,000		
コメダホールディングス	17,200	2,018.000	34,709,600		
フルサト・マルカホールディングス	7,500	3,100.000	23,250,000		
ヤマエグループホールディングス	6,200	1,012.000	6,274,400		
小野建	7,700	1,522.000	11,719,400		
佐鳥電機	6,400	952.000	6,092,800		
伯東	4,800	2,304.000	11,059,200		
コンドーテック	7,600	1,060.000	8,056,000		
ナガイレーベン	10,500	1,959.000	20,569,500		
三菱食品	7,000	3,025.000	21,175,000		
松田産業	5,800	2,360.000	13,688,000		
第一興商	14,800	3,335.000	49,358,000		
メディパルホールディングス	81,300	2,065.000	167,884,500		
ＳＰＫ	5,300	1,313.000	6,958,900		
萩原電気ホールディングス	3,700	1,941.000	7,181,700		
アズワン	11,000	6,970.000	76,670,000		
尾家産業	5,000	931.000	4,655,000		
シモジマ	6,500	899.000	5,843,500		

ドウシシャ	7,600	1,478.000	11,232,800		
高速	5,500	1,494.000	8,217,000		
丸文	8,900	666.000	5,927,400		
ハピネット	7,100	1,485.000	10,543,500		
日本ライフライン	22,900	1,098.000	25,144,200		
タカショー	8,400	677.000	5,686,800		
ＩＤＯＭ	23,800	742.000	17,659,600		
進和	5,200	1,964.000	10,212,800		
ダイトロン	3,800	1,834.000	6,969,200		
シークス	11,400	990.000	11,286,000		
オーハシテクニカ	5,600	1,269.000	7,106,400		
白銅	2,900	2,419.000	7,015,100		
伊藤忠商事	527,800	3,987.000	2,104,338,600		
丸紅	743,800	1,407.500	1,046,898,500		
長瀬産業	41,300	1,803.000	74,463,900		
蝶理	4,800	1,773.000	8,510,400		
豊田通商	75,500	4,665.000	352,207,500		
三共生興	14,300	499.000	7,135,700		
兼松	26,900	1,307.000	35,158,300		
三井物産	586,000	3,166.000	1,855,276,000		
日本紙パルプ商事	4,000	3,765.000	15,060,000		
カメイ	9,500	1,008.000	9,576,000		
スターゼン	6,000	1,919.000	11,514,000		
山善	30,800	928.000	28,582,400		
椿本興業	1,900	3,585.000	6,811,500		
住友商事	475,900	2,046.000	973,691,400		
内田洋行	3,400	4,605.000	15,657,000		
三菱商事	565,500	4,292.000	2,427,126,000		
第一実業	3,600	3,805.000	13,698,000		
キヤノンマーケティングジャパン	19,100	2,535.000	48,418,500		
西華産業	5,200	1,597.000	8,304,400		
佐藤商事	7,100	1,109.000	7,873,900		
菱洋エレクトロ	5,200	1,967.000	10,228,400		
東京産業	8,500	705.000	5,992,500		
ユアサ商事	6,900	2,839.000	19,589,100		
神鋼商事	2,000	3,345.000	6,690,000		
阪和興業	14,800	3,100.000	45,880,000		
正栄食品工業	4,900	3,885.000	19,036,500		
カナデン	8,100	997.000	8,075,700		
菱電商事	6,800	1,636.000	11,124,800		
岩谷産業	18,200	5,050.000	91,910,000		
ナイス	3,100	1,829.000	5,669,900		
極東貿易	2,700	2,119.000	5,721,300		
アステナホールディングス	13,500	418.000	5,643,000		
三愛オブリ	18,900	953.000	18,011,700		
稲畑産業	16,300	2,058.000	33,545,400		
ＧＳＩクレオス	4,700	1,136.000	5,339,200		
明和産業	7,500	885.000	6,637,500		

ワキタ	17,000	1,035.000	17,595,000		
東邦ホールディングス	25,100	2,000.000	50,200,000		
サンゲツ	20,200	1,491.000	30,118,200		
ミツウロコグループホールディングス	11,800	1,027.000	12,118,600		
シナネンホールディングス	3,200	3,240.000	10,368,000		
伊藤忠エネクス	15,800	1,043.000	16,479,400		
サンリオ	23,100	2,653.000	61,284,300		
サンワ　テクノス	5,400	1,248.000	6,739,200		
リョーサン	8,600	2,158.000	18,558,800		
新光商事	13,300	920.000	12,236,000		
トーホー	5,400	1,092.000	5,896,800		
三信電気	4,900	1,510.000	7,399,000		
東陽テクニカ	9,100	1,022.000	9,300,200		
モスフードサービス	9,900	2,874.000	28,452,600		
加賀電子	6,800	3,005.000	20,434,000		
ソーダニッカ	9,900	674.000	6,672,600		
立花エレテック	6,500	1,595.000	10,367,500		
ＰＡＬＴＡＣ	10,700	4,365.000	46,705,500		
太平洋興発	7,300	621.000	4,533,300		
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	2,200	2,755.000	6,061,000		
国際紙パルプ商事	19,400	294.000	5,703,600		
ヤマタネ	5,200	1,615.000	8,398,000		
日鉄物産	5,100	5,270.000	26,877,000		
泉州電業	2,200	5,010.000	11,022,000		
トラスコ中山	15,500	2,189.000	33,929,500		
オートバックスセブン	26,300	1,325.000	34,847,500		
モリト	7,800	743.000	5,795,400		
加藤産業	10,600	3,120.000	33,072,000		
イノテック	5,500	1,320.000	7,260,000		
イエローハット	12,900	1,581.000	20,394,900		
ＪＫホールディングス	6,800	1,152.000	7,833,600		
日伝	6,500	2,119.000	13,773,500		
杉本商事	4,200	2,026.000	8,509,200		
因幡電機産業	19,400	2,515.000	48,791,000		
東テク	3,100	2,134.000	6,615,400		
ミスミグループ本社	94,600	3,315.000	313,599,000		
タキヒヨー	4,400	1,114.000	4,901,600		
スズケン	29,700	3,795.000	112,711,500		
ジェコス	7,500	784.000	5,880,000		
ローソン	16,900	4,895.000	82,725,500		
サンエー	5,500	4,160.000	22,880,000		
カワチ薬品	5,900	2,170.000	12,803,000		
エービーシー・マート	11,800	4,850.000	57,230,000		
アスクル	17,200	1,581.000	27,193,200		
ゲオホールディングス	10,300	1,272.000	13,101,600		
アダストリア	8,200	1,987.000	16,293,400		
くら寿司	8,000	3,345.000	26,760,000		

キャンドゥ	3,900	2,301.000	8,973,900		
パルグループホールディングス	7,400	1,476.000	10,922,400		
エディオン	33,300	1,103.000	36,729,900		
サーラコーポレーション	17,100	625.000	10,687,500		
ハローズ	3,700	3,025.000	11,192,500		
フジオフードグループ本社	7,900	1,288.000	10,175,200		
あみやき亭	2,800	2,880.000	8,064,000		
大黒天物産	2,500	5,140.000	12,850,000		
ハニーズホールディングス	7,700	1,081.000	8,323,700		
アルペン	6,000	1,963.000	11,778,000		
クオールホールディングス	10,000	1,118.000	11,180,000		
ジンズホールディングス	5,300	4,685.000	24,830,500		
ビックカメラ	43,800	1,108.000	48,530,400		
ＤＣＭホールディングス	45,900	1,027.000	47,139,300		
ＭｏｎｏｔａＲＯ	95,500	2,522.000	240,851,000		
アークランドサービスホールディングス	6,100	2,190.000	13,359,000		
Ｊ．フロント　リテイリング	90,700	943.000	85,530,100		
ドトール・日レスホールディングス	12,700	1,422.000	18,059,400		
マツキヨココカラ＆カンパニー	46,400	4,335.000	201,144,000		
ブロンコビリー	5,200	2,252.000	11,710,400		
ＺＯＺＯ	52,200	3,120.000	162,864,000		
物語コーポレーション	3,800	5,600.000	21,280,000		
三越伊勢丹ホールディングス	132,100	957.000	126,419,700		
Ｈａｍｅｅ	3,900	1,223.000	4,769,700		
ウエルシアホールディングス	40,100	2,746.000	110,114,600		
クリエイトＳＤホールディングス	10,800	3,070.000	33,156,000		
チムニー	5,100	1,109.000	5,655,900		
シュッピン	7,200	1,295.000	9,324,000		
オイシックス・ラ・大地	10,900	2,950.000	32,155,000		
ネクステージ	15,300	2,170.000	33,201,000		
ジョイフル本田	22,400	1,579.000	35,369,600		
鳥貴族ホールディングス	3,700	1,820.000	6,734,000		
ホットランド	7,800	1,314.000	10,249,200		
すかいらーくホールディングス	97,800	1,507.000	147,384,600		
ＳＦＰホールディングス	5,500	1,335.000	7,342,500		
綿半ホールディングス	7,000	1,310.000	9,170,000		
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	20,600	1,129.000	23,257,400		
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,300	1,108.000	5,872,400		
ＢＥＥＮＯＳ	4,400	2,084.000	9,169,600		
あさひ	6,400	1,360.000	8,704,000		
日本調剤	5,500	1,266.000	6,963,000		
コスモス薬品	7,600	13,020.000	98,952,000		
セブン＆アイ・ホールディングス	295,500	5,645.000	1,668,097,500		
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	40,700	728.000	29,629,600		
ツルハホールディングス	16,500	6,870.000	113,355,000		
サンマルクホールディングス	8,000	1,473.000	11,784,000		

トリドールホールディングス	18,800	2,422.000	45,533,600		
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	9,200	398.000	3,661,600		
ＪＭホールディングス	5,900	1,746.000	10,301,400		
アレンザホールディングス	6,600	970.000	6,402,000		
串カツ田中ホールディングス	2,600	1,809.000	4,703,400		
バロックジャパンリミテッド	7,700	764.000	5,882,800		
クスリのアオキホールディングス	7,600	6,450.000	49,020,000		
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	44,200	3,120.000	137,904,000		
メディカルシステムネットワーク	9,000	539.000	4,851,000		
ノジマ	12,000	2,503.000	30,036,000		
カッパ・クリエイト	11,800	1,316.000	15,528,800		
良品計画	86,800	1,212.000	105,201,600		
アドヴァングループ	9,900	786.000	7,781,400		
アルビス	3,400	2,253.000	7,660,200		
Ｇ－７ホールディングス	8,900	1,690.000	15,041,000		
イオン北海道	13,500	1,006.000	13,581,000		
コジマ	14,000	606.000	8,484,000		
コーナン商事	10,700	3,680.000	39,376,000		
エコス	3,300	1,834.000	6,052,200		
ワタミ	10,800	903.000	9,752,400		
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	151,100	1,934.000	292,227,400		
西松屋チェーン	16,400	1,553.000	25,469,200		
ゼンショーホールディングス	36,900	2,908.000	107,305,200		
幸楽苑ホールディングス	6,800	1,221.000	8,302,800		
サイゼリヤ	11,500	2,325.000	26,737,500		
ＶＴホールディングス	28,400	487.000	13,830,800		
フジ・コーポレーション	5,600	1,179.000	6,602,400		
ユナイテッドアローズ	8,300	1,817.000	15,081,100		
ハイデイ日高	10,700	1,818.000	19,452,600		
コロワイド	31,400	1,639.000	51,464,600		
壱番屋	5,300	4,640.000	24,592,000		
スギホールディングス	15,200	5,780.000	87,856,000		
薬王堂ホールディングス	4,000	1,995.000	7,980,000		
スクロール	12,300	798.000	9,815,400		
ヨンドシーホールディングス	7,700	1,627.000	12,527,900		
木曽路	10,700	2,009.000	21,496,300		
ＳＲＳホールディングス	14,900	779.000	11,607,100		
千趣会	17,900	381.000	6,819,900		
リテールパートナーズ	9,800	1,390.000	13,622,000		
ケーヨー	15,800	872.000	13,777,600		
上新電機	8,200	1,912.000	15,678,400		
日本瓦斯	36,900	1,590.000	58,671,000		
ロイヤルホールディングス	13,300	2,033.000	27,038,900		
いなげや	9,700	1,353.000	13,124,100		
チヨダ	12,200	736.000	8,979,200		
ライフコーポレーション	7,000	3,185.000	22,295,000		

リンガーハット	10,000	2,248.000	22,480,000		
ＭｒＭａｘＨＤ	12,200	557.000	6,795,400		
ＡＯＫＩホールディングス	16,300	577.000	9,405,100		
オークワ	12,900	872.000	11,248,800		
コメリ	11,400	2,613.000	29,788,200		
青山商事	17,700	657.000	11,628,900		
しまむら	8,800	11,570.000	101,816,000		
高島屋	55,900	1,165.000	65,123,500		
松屋	17,000	778.000	13,226,000		
エイチ・ツー・オー　リテイリング	34,800	859.000	29,893,200		
近鉄百貨店	3,500	2,495.000	8,732,500		
丸井グループ	59,600	2,195.000	130,822,000		
アクシアル　リテイリング	5,900	3,365.000	19,853,500		
イオン	290,700	2,512.000	730,238,400		
イズミ	13,900	2,709.000	37,655,100		
平和堂	13,400	1,915.000	25,661,000		
フジ	20,600	2,038.000	41,982,800		
ヤオコー	8,700	7,010.000	60,987,000		
ゼビオホールディングス	11,400	919.000	10,476,600		
ケーズホールディングス	69,400	1,253.000	86,958,200		
日産東京販売ホールディングス	22,300	220.000	4,906,000		
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	3,400	3,960.000	13,464,000		
ブックオフグループホールディングス	5,600	981.000	5,493,600		
ギフトホールディングス	1,800	2,440.000	4,392,000		
アインホールディングス	10,200	5,930.000	60,486,000		
元気寿司	2,900	2,445.000	7,090,500		
ヤマダホールディングス	274,900	376.000	103,362,400		
アークランドサカモト	12,000	1,585.000	19,020,000		
ニトリホールディングス	29,900	14,375.000	429,812,500		
グルメ杵屋	10,800	1,002.000	10,821,600		
吉野家ホールディングス	26,500	2,270.000	60,155,000		
松屋フーズホールディングス	3,800	3,685.000	14,003,000		
サガミホールディングス	13,900	1,112.000	15,456,800		
関西フードマーケット	6,300	1,304.000	8,215,200		
王将フードサービス	4,900	5,930.000	29,057,000		
プレナス	8,700	2,010.000	17,487,000		
ミニストップ	7,000	1,368.000	9,576,000		
アークス	13,900	2,175.000	30,232,500		
バローホールディングス	16,200	2,114.000	34,246,800		
ベルク	3,400	5,430.000	18,462,000		
ファーストリテイリング	10,100	58,300.000	588,830,000		
サンドラッグ	28,600	3,060.000	87,516,000		
ベルーナ	17,100	717.000	12,260,700		
めぶきフィナンシャルグループ	390,200	251.000	97,940,200		
東京きらぼしフィナンシャルグループ	9,800	1,720.000	16,856,000		
九州フィナンシャルグループ	150,200	390.000	58,578,000		
ゆうちょ銀行	178,300	964.000	171,881,200		
富山第一銀行	9,800	311.000	3,047,800		

コンコルディア・フィナンシャルグループ	429,200	464.000	199,148,800		
西日本フィナンシャルホールディングス	49,600	747.000	37,051,200		
三十三フィナンシャルグループ	7,700	1,429.000	11,003,300		
第四北越フィナンシャルグループ	12,400	2,503.000	31,037,200		
ひろぎんホールディングス	111,700	638.000	71,264,600		
おきなわフィナンシャルグループ	7,000	2,144.000	15,008,000		
十六フィナンシャルグループ	10,500	2,151.000	22,585,500		
北國フィナンシャルホールディングス	7,400	3,370.000	24,938,000		
プロクレアホールディングス	7,670	1,776.000	13,621,920		
新生銀行	49,400	2,329.000	115,052,600		
あおぞら銀行	41,500	2,549.000	105,783,500		
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	4,741,100	746.700	3,540,179,370		
りそなホールディングス	857,600	543.300	465,934,080		
三井住友トラスト・ホールディングス	142,800	3,878.000	553,778,400		
三井住友フィナンシャルグループ	523,400	3,900.000	2,041,260,000		
千葉銀行	251,700	760.000	191,292,000		
群馬銀行	140,200	361.000	50,612,200		
武蔵野銀行	11,600	1,767.000	20,497,200		
筑波銀行	26,300	194.000	5,102,200		
七十七銀行	23,700	1,514.000	35,881,800		
秋田銀行	4,300	1,638.000	7,043,400		
山形銀行	10,600	841.000	8,914,600		
岩手銀行	6,000	1,895.000	11,370,000		
東邦銀行	73,100	204.000	14,912,400		
東北銀行	2,000	1,000.000	2,000,000		
ふくおかフィナンシャルグループ	63,300	2,367.000	149,831,100		
静岡銀行	183,800	848.000	155,862,400		
スルガ銀行	67,500	421.000	28,417,500		
八十二銀行	168,500	416.000	70,096,000		
山梨中央銀行	10,800	947.000	10,227,600		
大垣共立銀行	15,100	1,899.000	28,674,900		
福井銀行	8,000	1,357.000	10,856,000		
清水銀行	4,400	1,533.000	6,745,200		
富山銀行	2,400	1,990.000	4,776,000		
滋賀銀行	14,300	2,372.000	33,919,600		
南都銀行	12,200	1,999.000	24,387,800		
百五銀行	73,900	338.000	24,978,200		
京都銀行	27,000	5,250.000	141,750,000		
紀陽銀行	25,800	1,385.000	35,733,000		
ほくほくフィナンシャルグループ	47,600	863.000	41,078,800		
山陰合同銀行	45,900	630.000	28,917,000		
中国銀行	59,800	917.000	54,836,600		
伊予銀行	99,300	604.000	59,977,200		
百十四銀行	9,200	1,627.000	14,968,400		
四国銀行	13,400	727.000	9,741,800		
阿波銀行	11,800	2,155.000	25,429,000		
大分銀行	5,500	1,839.000	10,114,500		

宮崎銀行	5,400	2,048.000	11,059,200		
佐賀銀行	4,500	1,422.000	6,399,000		
琉球銀行	18,200	800.000	14,560,000		
セブン銀行	224,400	238.000	53,407,200		
みずほフィナンシャルグループ	967,400	1,560.500	1,509,627,700		
山口フィナンシャルグループ	88,700	700.000	62,090,000		
名古屋銀行	5,800	2,841.000	16,477,800		
北洋銀行	115,700	239.000	27,652,300		
愛知銀行	2,900	4,590.000	13,311,000		
中京銀行	4,000	1,578.000	6,312,000		
愛媛銀行	13,100	879.000	11,514,900		
京葉銀行	33,500	492.000	16,482,000		
栃木銀行	43,200	228.000	9,849,600		
東和銀行	17,400	525.000	9,135,000		
トモニホールディングス	60,300	319.000	19,235,700		
フィデアホールディングス	8,500	1,282.000	10,897,000		
池田泉州ホールディングス	94,200	171.000	16,108,200		
ＦＰＧ	27,600	837.000	23,101,200		
ジャパンインベストメントアドバイザー	6,900	1,181.000	8,148,900		
ＳＢＩホールディングス	92,700	2,901.000	268,922,700		
ジャフコ　グループ	29,300	1,796.000	52,622,800		
大和証券グループ本社	566,100	641.000	362,870,100		
野村ホールディングス	1,153,500	498.100	574,558,350		
岡三証券グループ	62,200	363.000	22,578,600		
丸三証券	22,100	487.000	10,762,700		
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	85,100	397.000	33,784,700		
水戸証券	26,100	267.000	6,968,700		
いちよし証券	17,300	600.000	10,380,000		
松井証券	37,500	836.000	31,350,000		
マネックスグループ	62,000	634.000	39,308,000		
極東証券	10,300	717.000	7,385,100		
岩井コスモホールディングス	8,300	1,324.000	10,989,200		
アイザワ証券グループ	14,200	692.000	9,826,400		
スパークス・グループ	41,100	265.000	10,891,500		
かんぽ生命保険	76,300	2,136.000	162,976,800		
ＳＯＭＰＯホールディングス	123,900	5,108.000	632,881,200		
アニコム　ホールディングス	26,500	620.000	16,430,000		
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	169,100	3,771.000	637,676,100		
第一生命ホールディングス	371,800	2,525.500	938,980,900		
東京海上ホールディングス	249,000	6,736.000	1,677,264,000		
Ｔ＆Ｄホールディングス	195,800	1,630.000	319,154,000		
アドバンスクリエイト	5,500	911.000	5,010,500		
全国保証	18,200	4,685.000	85,267,000		
ジェイリース	2,900	1,629.000	4,724,100		
日本モーゲージサービス	4,100	954.000	3,911,400		
アルヒ	12,400	1,020.000	12,648,000		

プレミアグループ	4,200	3,990.000	16,758,000		
ネットプロテクションズホールディングス	18,200	895.000	16,289,000		
クレディセゾン	48,200	1,311.000	63,190,200		
芙蓉総合リース	7,800	7,020.000	54,756,000		
みずほリース	11,700	3,045.000	35,626,500		
東京センチュリー	14,500	4,105.000	59,522,500		
日本証券金融	31,600	949.000	29,988,400		
アイフル	129,000	366.000	47,214,000		
リコーリース	7,100	3,340.000	23,714,000		
イオンフィナンシャルサービス	40,500	1,163.000	47,101,500		
アコム	151,100	326.000	49,258,600		
ジャックス	8,600	3,070.000	26,402,000		
オリエントコーポレーション	208,600	124.000	25,866,400		
オリックス	449,500	2,298.500	1,033,175,750		
三菱ＨＣキャピタル	277,000	572.000	158,444,000		
日本取引所グループ	188,700	2,225.500	419,951,850		
イー・ギャランティ	11,300	2,165.000	24,464,500		
ＮＥＣキャピタルソリューション	4,000	2,065.000	8,260,000		
いちご	89,600	307.000	27,507,200		
日本駐車場開発	101,600	149.000	15,138,400		
スター・マイカ・ホールディングス	6,800	1,694.000	11,519,200		
ＳＲＥホールディングス	2,600	3,590.000	9,334,000		
ヒューリック	180,900	1,090.000	197,181,000		
三栄建築設計	4,300	1,629.000	7,004,700		
野村不動産ホールディングス	39,000	2,964.000	115,596,000		
三重交通グループホールディングス	20,700	446.000	9,232,200		
サムティ	10,100	2,079.000	20,997,900		
ディア・ライフ	13,800	519.000	7,162,200		
地主	6,500	1,927.000	12,525,500		
プレサンスコーポレーション	11,200	1,728.000	19,353,600		
日本管理センター	6,700	998.000	6,686,600		
フージャースホールディングス	13,300	648.000	8,618,400		
オープンハウスグループ	24,000	5,390.000	129,360,000		
東急不動産ホールディングス	223,200	673.000	150,213,600		
飯田グループホールディングス	63,000	2,069.000	130,347,000		
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	5,700	941.000	5,363,700		
シーアールイー	4,100	1,637.000	6,711,700		
ケイアイスター不動産	3,900	5,630.000	21,957,000		
グッドコムアセット	5,500	1,083.000	5,956,500		
ジェイ・エス・ビー	2,100	3,450.000	7,245,000		
パーク２４	41,000	1,746.000	71,586,000		
パラカ	4,400	1,727.000	7,598,800		
宮越ホールディングス	4,500	877.000	3,946,500		
三井不動産	344,400	2,708.000	932,635,200		
三菱地所	497,700	1,840.000	915,768,000		
平和不動産	13,500	4,130.000	55,755,000		
東京建物	74,800	1,816.000	135,836,800		

京阪神ビルディング	13,200	1,414.000	18,664,800		
住友不動産	159,000	3,456.000	549,504,000		
テーオーシー	16,900	651.000	11,001,900		
東京楽天地	1,600	4,020.000	6,432,000		
スターツコーポレーション	11,200	2,372.000	26,566,400		
フジ住宅	12,900	603.000	7,778,700		
空港施設	13,200	529.000	6,982,800		
ゴールドクレスト	7,700	1,642.000	12,643,400		
日神グループホールディングス	17,300	452.000	7,819,600		
日本エスコン	16,100	820.000	13,202,000		
タカラレーベン	41,800	297.000	12,414,600		
ＡＶＡＮＴＩＡ	7,900	844.000	6,667,600		
イオンモール	38,400	1,528.000	58,675,200		
カチタス	19,500	3,370.000	65,715,000		
トーセイ	12,200	1,115.000	13,603,000		
サンフロンティア不動産	12,800	1,048.000	13,414,400		
ＦＪネクストホールディングス	9,500	985.000	9,357,500		
日本空港ビルデング	29,000	5,440.000	157,760,000		
日本工営	4,900	2,912.000	14,268,800		
ＬＩＦＵＬＬ	30,100	239.000	7,193,900		
ミクシィ	17,000	2,228.000	37,876,000		
ジェイエイシーリクルートメント	6,600	1,888.000	12,460,800		
日本M&Aセンターホールディングス	120,700	1,715.000	207,000,500		
メンバーズ	2,600	3,260.000	8,476,000		
ＵＴグループ	10,600	2,973.000	31,513,800		
アイティメディア	4,300	1,721.000	7,400,300		
Ｅ・Ｊホールディングス	5,200	1,181.000	6,141,200		
夢真ビーネックスグループ	23,900	1,684.000	40,247,600		
コシダカホールディングス	20,500	680.000	13,940,000		
パソナグループ	7,900	2,392.000	18,896,800		
リンクアンドモチベーション	18,800	513.000	9,644,400		
エス・エム・エス	25,200	3,420.000	86,184,000		
パーソルホールディングス	73,200	2,695.000	197,274,000		
リニカル	7,000	818.000	5,726,000		
クックパッド	30,300	286.000	8,665,800		
スタジオアリス	4,200	2,318.000	9,735,600		
シミックホールディングス	5,400	1,546.000	8,348,400		
綜合警備保障	29,300	3,600.000	105,480,000		
カカクコム	54,100	2,638.000	142,715,800		
アイロムグループ	3,500	2,074.000	7,259,000		
ルネサンス	6,700	924.000	6,190,800		
ディップ	12,900	3,490.000	45,021,000		
デジタルホールディングス	5,700	1,445.000	8,236,500		
新日本科学	9,700	1,591.000	15,432,700		
ベネフィット・ワン	26,900	2,451.000	65,931,900		
エムスリー	129,300	4,764.000	615,985,200		
アウトソーシング	42,300	1,245.000	52,663,500		
ウェルネット	15,500	499.000	7,734,500		

ワールドホールディングス	3,300	2,453.000	8,094,900		
ディー・エヌ・エー	28,500	1,955.000	55,717,500		
博報堂ＤＹホールディングス	102,000	1,484.000	151,368,000		
ぐるなび	16,300	417.000	6,797,100		
タカミヤ	15,600	361.000	5,631,600		
ジャパンベストレスキューシステム	6,000	978.000	5,868,000		
ファンコミュニケーションズ	24,200	440.000	10,648,000		
ライク	3,200	1,880.000	6,016,000		
エスプール	21,000	1,368.000	28,728,000		
ＷＤＢホールディングス	3,700	2,723.000	10,075,100		
アドウェイズ	12,000	825.000	9,900,000		
バリューコマース	5,700	3,740.000	21,318,000		
インフォマート	81,600	715.000	58,344,000		
ＪＰホールディングス	27,600	212.000	5,851,200		
プレステージ・インターナショナル	28,400	664.000	18,857,600		
アミューズ	4,800	1,967.000	9,441,600		
ドリームインキュベータ	2,700	2,392.000	6,458,400		
クイック	6,100	1,567.000	9,558,700		
電通グループ	75,500	4,860.000	366,930,000		
ぴあ	2,900	3,270.000	9,483,000		
イオンファンタジー	3,800	2,098.000	7,972,400		
シーティーエス	10,000	875.000	8,750,000		
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	19,500	3,000.000	58,500,000		
アルプス技研	7,300	1,949.000	14,227,700		
日本空調サービス	10,600	793.000	8,405,800		
オリエンタルランド	86,600	22,630.000	1,959,758,000		
ダスキン	17,600	2,713.000	47,748,800		
明光ネットワークジャパン	13,700	579.000	7,932,300		
ファルコホールディングス	4,500	2,104.000	9,468,000		
ラウンドワン	20,700	1,441.000	29,828,700		
リゾートトラスト	34,000	2,110.000	71,740,000		
ビー・エム・エル	9,400	3,215.000	30,221,000		
りらいあコミュニケーションズ	11,900	1,066.000	12,685,400		
リソー教育	36,500	379.000	13,833,500		
ユー・エス・エス	82,300	2,033.000	167,315,900		
東京個別指導学院	9,200	586.000	5,391,200		
サイバーエージェント	180,900	1,494.000	270,264,600		
楽天グループ	377,100	933.000	351,834,300		
クリーク・アンド・リバー社	4,500	2,048.000	9,216,000		
モーニングスター	16,200	594.000	9,622,800		
山田コンサルティンググループ	5,000	1,254.000	6,270,000		
セントラルスポーツ	3,900	2,329.000	9,083,100		
フルキャストホールディングス	6,400	2,570.000	16,448,000		
エン・ジャパン	11,800	3,085.000	36,403,000		
テクノプロ・ホールディングス	44,000	3,210.000	141,240,000		
アイ・アールジャパンホールディングス	3,600	4,660.000	16,776,000		
ＫｅｅＰｅｒ技研	5,100	2,752.000	14,035,200		
Ｇｕｎｏｓｙ	5,200	1,068.000	5,553,600		

イー・ガーディアン	3,400	3,235.000	10,999,000		
ジャパンマテリアル	22,500	1,784.000	40,140,000		
ベクトル	11,200	1,230.000	13,776,000		
チャーム・ケア・コーポレーション	6,100	1,246.000	7,600,600		
キャリアリンク	3,300	1,458.000	4,811,400		
ＩＢＪ	8,000	743.000	5,944,000		
アサンテ	5,200	1,469.000	7,638,800		
バリューＨＲ	7,000	1,465.000	10,255,000		
M&Aキャピタルパートナーズ	6,100	4,670.000	28,487,000		
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,900	1,210.000	4,719,000		
ＥＲＩホールディングス	2,900	1,227.000	3,558,300		
シグマクシス・ホールディングス	9,600	1,188.000	11,404,800		
ウィルグループ	6,100	1,136.000	6,929,600		
メドピア	5,800	4,160.000	24,128,000		
リクルートホールディングス	565,300	5,397.000	3,050,924,100		
エラン	12,100	1,065.000	12,886,500		
日本郵政	955,900	889.900	850,655,410		
ベルシステム２４ホールディングス	10,800	1,461.000	15,778,800		
鎌倉新書	11,000	584.000	6,424,000		
エアトリ	5,000	3,170.000	15,850,000		
アトラエ	5,600	1,846.000	10,337,600		
ストライク	3,300	4,390.000	14,487,000		
ソラスト	18,400	960.000	17,664,000		
インソース	7,400	2,132.000	15,776,800		
ベイカレント・コンサルティング	5,200	42,600.000	221,520,000		
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1,800	2,849.000	5,128,200		
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	23,300	1,676.000	39,050,800		
ウェルビー	6,000	1,042.000	6,252,000		
エル・ティー・エス	1,500	2,967.000	4,450,500		
ミダックホールディングス	3,600	2,492.000	8,971,200		
日総工産	7,300	715.000	5,219,500		
キュービーネットホールディングス	4,500	1,411.000	6,349,500		
ＲＰＡホールディングス	14,400	348.000	5,011,200		
スプリックス	3,000	1,229.000	3,687,000		
マネジメントソリューションズ	3,800	4,905.000	18,639,000		
カーブスホールディングス	21,000	723.000	15,183,000		
ＦＡＳＴ　ＦＩＴＮＥＳＳ　ＪＡＰＡＮ	1,500	2,045.000	3,067,500		
ダイレクトマーケティングミックス	9,400	1,701.000	15,989,400		
ポピンズ	2,200	2,070.000	4,554,000		
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	6,200	2,931.000	18,172,200		
アドバンテッジリスクマネジメント	6,000	584.000	3,504,000		
リログループ	40,600	1,831.000	74,338,600		
東祥	6,400	1,680.000	10,752,000		
ＴＲＥホールディングス	10,300	2,360.000	24,308,000		
人・夢・技術グループ	3,600	2,082.000	7,495,200		
エイチ・アイ・エス	16,500	2,121.000	34,996,500		

ラックランド	3,600	2,951.000	10,623,600	
共立メンテナンス	13,000	4,455.000	57,915,000	
イチネンホールディングス	8,500	1,243.000	10,565,500	
建設技術研究所	4,900	2,176.000	10,662,400	
燦ホールディングス	4,400	1,538.000	6,767,200	
東京テアトル	6,100	1,227.000	7,484,700	
ナガワ	2,300	9,090.000	20,907,000	
東京都競馬	5,600	4,350.000	24,360,000	
カナモト	12,700	1,957.000	24,853,900	
西尾レントオール	6,700	2,689.000	18,016,300	
トランス・コスモス	9,400	3,105.000	29,187,000	
乃村工藝社	31,600	908.000	28,692,800	
日本管財	7,600	2,817.000	21,409,200	
トーカイ	6,900	1,706.000	11,771,400	
セコム	72,200	8,851.000	639,042,200	
セントラル警備保障	4,000	2,187.000	8,748,000	
丹青社	16,300	777.000	12,665,100	
メイテック	9,100	6,680.000	60,788,000	
応用地質	8,300	1,975.000	16,392,500	
船井総研ホールディングス	15,200	2,231.000	33,911,200	
オオバ	8,100	732.000	5,929,200	
ベネッセホールディングス	25,100	2,192.000	55,019,200	
イオンディライト	9,000	2,802.000	25,218,000	
ダイセキ	13,300	4,375.000	58,187,500	
合　計	82,874,820		197,920,121,230	

(b)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「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4月13日現在）	（2022年4月13日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	271,148,043	78,454,043
コール・ローン	140,524,695	3,009,448,965
国債証券	105,477,475,540	109,049,192,830
地方債証券	8,542,550,820	9,573,035,400
特殊債券	11,582,718,565	9,360,292,837
社債券	4,045,168,000	5,074,875,400
未収利息	230,194,166	206,523,392
前払費用	3,090,887	3,702,938
流動資産合計	130,292,870,716	136,355,525,805

資産合計	130,292,870,716	136,355,525,805
負債の部		
流動負債		
未払金	52,732,500	2,783,309,300
未払解約金	3,455,246	28,069,291
未払利息	384	-
その他未払費用	5,597	1,645
流動負債合計	56,193,727	2,811,380,236
負債合計	56,193,727	2,811,380,236
純資産の部		
元本等		
元本	102,034,101,931	106,340,184,500
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	28,202,575,058	27,203,961,069
元本等合計	130,236,676,989	133,544,145,569
純資産合計	130,236,676,989	133,544,145,569
負債純資産合計	130,292,870,716	136,355,525,805

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2021年4月14日 至 2022年4月13日
１．有価証券の評価基準及び評価方法	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。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。

（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4月13日現在）	（2022年4月13日現在）
１．当計算期間の末日における受益権の総数	102,034,101,931口	106,340,184,500口

２．１単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　1.2764円 （１万口当たりの純資産額12,764円）	1口当たり純資産額　1.2558円 （１万口当たりの純資産額12,558円）

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	自 2021年4月14日 至 2022年4月13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	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。 　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、上下限値、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。 　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。
４．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	（2022年4月13日現在）
１．　貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 　「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） 　デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 　これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 2021年4月14日 至 2022年4月13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4月13日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	102,757,947,265円
同期中における追加設定元本額	23,130,574,048円
同期中における一部解約元本額	23,854,419,382円
2021年4月13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）	6,094,869,774円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	10,799,784,589円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	2,409,904,423円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	650,911,787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）	43,319,205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）	200,477,835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）	430,298,494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）	542,880,234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）	237,927,219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）	394,951,809円
三井住友・ＤＣ年金バランスゼロ（債券型）	139,859,405円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	1,262,690,529円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	398,901,014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ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	32,881,227円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	1,220,630,022円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	398,613,032円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	568,525,120円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	118,550,076円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	33,192,378円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	90,202,755円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	79,038,998円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	126,731,002円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	35,039,983円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	4,679,578円
ＳＭＡＭ・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	1,615,752,867円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	14,461,969,440円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	6,723,802,531円

ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	16,890,224,082円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	330,039,962円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	596,483,349円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	264,477,800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＞	1,898,851,071円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	2,189,946,035円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	2,559,318,640円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	9,289,850,382円
ＳＭＡＭ・バランスＶＡ株４０Ｔ＜適格機関投資家限定＞	948,903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）	1,263,341,710円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	469,017,209円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	595,459,501円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	180,178,556円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	43,116,807円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	1,639,537,473円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	2,264,897,999円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	808,518,064円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	216,345,674円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	18,836,644円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３０Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	299,035,679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＞	344,315,421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＞	907,783,289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＞	758,516,436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Ⅱ＜適格機関投資家限定＞	3,372,540,023円
合　計	102,034,101,931円

（2022年4月13日現在）

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	102,034,101,931円
同期中における追加設定元本額	21,659,250,973円
同期中における一部解約元本額	17,353,168,404円
2022年4月13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）	6,923,891,754円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	11,792,397,296円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	2,736,892,316円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	839,744,278円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）	44,108,804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）	187,516,541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）	486,968,806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）	750,745,280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）	365,715,230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）	518,385,905円
三井住友・ＤＣ年金バランスゼロ（債券型）	140,087,519円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	1,955,662,979円

アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	1,043,531,372円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	412,203,992円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	46,655,634円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	1,982,377,274円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	668,842,364円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	1,064,221,378円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	248,790,463円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	92,208,160円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	159,906,861円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	122,767,259円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	231,236,748円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	72,742,695円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	5,891,970円
ＳＭＡＭ・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	1,421,401,910円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	12,050,047,984円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	6,248,907,618円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	15,755,830,892円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	320,961,241円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	557,125,171円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	265,176,086円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ国際分散型＜適格機関投資家限定＞	122,772,968円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	1,830,653,508円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	2,180,257,745円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	2,384,904,244円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	8,380,559,091円
ＳＭＡＭ・バランスＶＡ株４０Ｔ＜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・ＶＡＳ（適格機関投資家専用）	1,159,868,412円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	446,913,980円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	535,210,250円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	179,486,947円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	44,152,419円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	1,440,382,485円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	2,107,627,635円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	683,112,177円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	205,571,184円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	18,779,320円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３０Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	272,432,388円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	5,120,316,774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＞	1,146,512,165円
ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジーファンド２０１６－０４＜適格機関投資家限定＞	1,157,293,722円
ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞	1,481,392,104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Ⅱ＜適格機関投資家限定＞	5,928,068,863円
合　計	106,340,184,500円

（３）附属明細表

①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	４３１　２年国債	50,000,000	50,077,500	
	４３２　２年国債	750,000,000	751,155,000	
	４３３　２年国債	330,000,000	330,504,900	
	４３４　２年国債	1,130,000,000	1,131,796,700	
	４３５　２年国債	3,780,000,000	3,785,556,600	
	１３８　５年国債	600,000,000	601,872,000	
	１３９　５年国債	260,000,000	260,878,800	
	１４０　５年国債	600,000,000	602,160,000	
	１４１　５年国債	795,000,000	798,100,500	
	１４２　５年国債	760,000,000	763,161,600	
	１４３　５年国債	770,000,000	773,272,500	
	１４４　５年国債	980,000,000	984,214,000	
	１４５　５年国債	1,080,000,000	1,084,633,200	
	１４６　５年国債	1,550,000,000	1,556,851,000	
	１４７　５年国債	1,540,000,000	1,540,893,200	
	１４８　５年国債	1,070,000,000	1,070,214,000	
	１４９　５年国債	1,240,000,000	1,239,714,800	
	１５０　５年国債	2,510,000,000	2,508,217,900	
	１　４０年国債	40,000,000	53,686,800	
	２　４０年国債	242,000,000	314,282,980	
	３　４０年国債	185,000,000	241,647,000	
	４　４０年国債	247,000,000	323,303,240	
	５　４０年国債	235,000,000	297,002,400	
	６　４０年国債	240,000,000	298,430,400	
	７　４０年国債	285,000,000	340,284,300	
	８　４０年国債	300,000,000	334,281,000	
	９　４０年国債	513,000,000	425,318,040	
	１０　４０年国債	450,000,000	437,215,500	
	１１　４０年国債	380,000,000	357,078,400	
	１２　４０年国債	380,000,000	320,963,200	
	１３　４０年国債	475,000,000	399,251,750	
	１４　４０年国債	475,000,000	426,697,250	
	３３２　１０年国債	793,000,000	802,159,150	
	３３３　１０年国債	815,000,000	825,635,750	
	３３４　１０年国債	315,000,000	319,580,100	
	３３５　１０年国債	90,000,000	91,228,500	
	３３６　１０年国債	340,000,000	345,072,800	
	３３７　１０年国債	120,000,000	121,144,800	
	３３８　１０年国債	805,000,000	815,513,300	

３３９　１０年国債	785,000,000	795,880,100	
３４０　１０年国債	770,000,000	781,249,700	
３４１　１０年国債	557,000,000	563,572,600	
３４２　１０年国債	350,000,000	351,512,000	
３４３　１０年国債	310,000,000	311,295,800	
３４４　１０年国債	811,000,000	814,235,890	
３４５　１０年国債	258,000,000	258,964,920	
３４６　１０年国債	540,000,000	541,857,600	
３４７　１０年国債	680,000,000	682,108,000	
３４８　１０年国債	625,000,000	626,518,750	
３４９　１０年国債	610,000,000	611,030,900	
３５０　１０年国債	590,000,000	590,696,200	
３５１　１０年国債	390,000,000	390,117,000	
３５２　１０年国債	570,000,000	569,817,600	
３５３　１０年国債	520,000,000	519,308,400	
３５４　１０年国債	435,000,000	433,951,650	
３５５　１０年国債	700,000,000	697,508,000	
３５６　１０年国債	940,000,000	935,506,800	
３５７　１０年国債	910,000,000	904,822,100	
３５８　１０年国債	1,130,000,000	1,122,485,500	
３５９　１０年国債	1,210,000,000	1,200,731,400	
３６０　１０年国債	1,120,000,000	1,110,704,000	
３６１　１０年国債	1,310,000,000	1,297,699,100	
３６２　１０年国債	1,150,000,000	1,138,408,000	
３６３　１０年国債	800,000,000	791,000,000	
３６４　１０年国債	950,000,000	938,590,500	
３６５　１０年国債	1,060,000,000	1,046,442,600	
３６６　１０年国債	340,000,000	338,844,000	
２　３０年国債	510,000,000	598,153,500	
４　３０年国債	340,000,000	418,166,000	
５　３０年国債	290,000,000	341,675,100	
７　３０年国債	474,000,000	571,397,520	
９　３０年国債	240,000,000	268,581,600	
１０　３０年国債	465,000,000	505,980,450	
１１　３０年国債	430,000,000	496,482,300	
１２　３０年国債	570,000,000	684,951,900	
１４　３０年国債	622,000,000	772,013,960	
１６　３０年国債	465,000,000	585,881,400	
１８　３０年国債	540,000,000	670,685,400	
１９　３０年国債	470,000,000	585,126,500	
２１　３０年国債	345,000,000	431,167,200	
２２　３０年国債	315,000,000	402,822,000	
２３　３０年国債	329,000,000	421,731,940	
２４　３０年国債	310,000,000	398,300,400	
２５　３０年国債	290,000,000	365,156,400	

２６　３０年国債	363,000,000	463,006,500	
２７　３０年国債	420,000,000	543,484,200	
２８　３０年国債	386,000,000	500,653,580	
２９　３０年国債	177,000,000	227,384,820	
３０　３０年国債	442,000,000	561,804,100	
３１　３０年国債	325,000,000	408,690,750	
３２　３０年国債	360,000,000	459,824,400	
３３　３０年国債	368,000,000	451,642,720	
３４　３０年国債	457,000,000	576,889,380	
３５　３０年国債	350,000,000	429,677,500	
３６　３０年国債	90,000,000	110,657,700	
３７　３０年国債	435,000,000	527,850,750	
３８　３０年国債	410,000,000	490,544,500	
３９　３０年国債	180,000,000	219,038,400	
４０　３０年国債	270,000,000	323,546,400	
４１　３０年国債	270,000,000	318,432,600	
４２　３０年国債	280,000,000	330,094,800	
４３　３０年国債	285,000,000	336,174,600	
４４　３０年国債	280,000,000	330,447,600	
４５　３０年国債	355,000,000	404,263,350	
４６　３０年国債	315,000,000	358,766,100	
４７　３０年国債	330,000,000	382,750,500	
４８　３０年国債	335,000,000	374,298,850	
４９　３０年国債	315,000,000	351,930,600	
５０　３０年国債	295,000,000	291,197,450	
５１　３０年国債	315,000,000	276,091,200	
５２　３０年国債	343,000,000	314,884,290	
５３　３０年国債	307,000,000	288,104,150	
５４　３０年国債	75,000,000	73,547,250	
５５　３０年国債	325,000,000	318,324,500	
５６　３０年国債	500,000,000	489,145,000	
５７　３０年国債	355,000,000	346,508,400	
５８　３０年国債	340,000,000	331,109,000	
５９　３０年国債	360,000,000	341,845,200	
６０　３０年国債	350,000,000	347,770,500	
６１　３０年国債	345,000,000	325,942,200	
６２　３０年国債	165,000,000	147,651,900	
６３　３０年国債	320,000,000	278,070,400	
６４　３０年国債	305,000,000	264,178,800	
６５　３０年国債	305,000,000	263,889,050	
６６　３０年国債	310,000,000	268,218,200	
６７　３０年国債	350,000,000	318,867,500	
６８　３０年国債	350,000,000	318,650,500	
６９　３０年国債	440,000,000	411,030,400	
７０　３０年国債	350,000,000	326,070,500	

７１　３０年国債	320,000,000	297,974,400	
７２　３０年国債	380,000,000	353,669,800	
７３　３０年国債	410,000,000	380,972,000	
７４　３０年国債	10,000,000	10,046,200	
６５　２０年国債	1,020,000,000	1,054,159,800	
６９　２０年国債	1,020,000,000	1,062,911,400	
７０　２０年国債	780,000,000	822,042,000	
７２　２０年国債	753,000,000	792,668,040	
７４　２０年国債	664,000,000	702,472,160	
７５　２０年国債	490,000,000	520,850,400	
７８　２０年国債	590,000,000	626,385,300	
８２　２０年国債	620,000,000	665,297,200	
８４　２０年国債	500,000,000	537,245,000	
８５　２０年国債	645,000,000	698,522,100	
８８　２０年国債	742,000,000	813,395,240	
８９　２０年国債	20,000,000	21,840,600	
９０　２０年国債	580,000,000	636,312,200	
９２　２０年国債	424,000,000	465,276,400	
９３　２０年国債	632,000,000	693,304,000	
９５　２０年国債	305,000,000	340,654,500	
９７　２０年国債	677,000,000	755,694,480	
９９　２０年国債	153,000,000	170,634,780	
１００　２０年国債	207,000,000	232,974,360	
１０１　２０年国債	355,000,000	403,737,950	
１０２　２０年国債	457,000,000	521,912,280	
１０５　２０年国債	390,000,000	439,873,200	
１０６　２０年国債	370,000,000	419,683,600	
１０７　２０年国債	378,000,000	427,775,040	
１０８　２０年国債	390,000,000	436,179,900	
１０９　２０年国債	140,000,000	157,075,800	
１１１　２０年国債	386,000,000	442,549,000	
１１３　２０年国債	227,000,000	259,454,190	
１１４　２０年国債	263,000,000	301,618,920	
１１６　２０年国債	100,000,000	115,841,000	
１１８　２０年国債	200,000,000	229,262,000	
１１９　２０年国債	295,000,000	333,406,050	
１２０　２０年国債	200,000,000	222,814,000	
１２１　２０年国債	55,000,000	62,808,350	
１２２　２０年国債	330,000,000	374,111,100	
１２３　２０年国債	80,000,000	93,015,200	
１２４　２０年国債	190,000,000	219,288,500	
１２５　２０年国債	205,000,000	240,975,450	
１２６　２０年国債	180,000,000	208,429,200	
１２７　２０年国債	145,000,000	166,629,650	
１２８　２０年国債	65,000,000	74,896,900	

１３０　２０年国債	155,000,000	177,719,900	
１３１　２０年国債	380,000,000	432,185,400	
１３２　２０年国債	450,000,000	513,153,000	
１３３　２０年国債	190,000,000	218,465,800	
１３４　２０年国債	200,000,000	230,712,000	
１３５　２０年国債	155,000,000	177,295,200	
１３６　２０年国債	120,000,000	136,094,400	
１３７　２０年国債	185,000,000	212,059,950	
１３９　２０年国債	60,000,000	68,179,200	
１４０　２０年国債	340,000,000	390,534,200	
１４２　２０年国債	190,000,000	220,647,000	
１４３　２０年国債	120,000,000	137,018,400	
１４４　２０年国債	170,000,000	192,304,000	
１４５　２０年国債	110,000,000	127,007,100	
１４６　２０年国債	95,000,000	109,886,500	
１４７　２０年国債	210,000,000	240,817,500	
１４８　２０年国債	219,000,000	248,840,940	
１４９　２０年国債	575,000,000	654,177,500	
１５０　２０年国債	391,000,000	440,449,770	
１５１　２０年国債	580,000,000	639,484,800	
１５２　２０年国債	585,000,000	645,319,350	
１５３　２０年国債	437,000,000	487,779,400	
１５４　２０年国債	380,000,000	419,292,000	
１５５　２０年国債	410,000,000	441,627,400	
１５６　２０年国債	480,000,000	477,792,000	
１５７　２０年国債	335,000,000	323,616,700	
１５８　２０年国債	410,000,000	412,218,100	
１５９　２０年国債	388,000,000	394,925,800	
１６０　２０年国債	355,000,000	365,880,750	
１６１　２０年国債	380,000,000	385,361,800	
１６２　２０年国債	370,000,000	374,495,500	
１６３　２０年国債	430,000,000	434,355,900	
１６４　２０年国債	385,000,000	382,177,950	
１６５　２０年国債	390,000,000	386,240,400	
１６６　２０年国債	335,000,000	341,287,950	
１６７　２０年国債	400,000,000	393,932,000	
１６８　２０年国債	480,000,000	463,814,400	
１６９　２０年国債	400,000,000	378,944,000	
１７０　２０年国債	385,000,000	363,609,400	
１７１　２０年国債	345,000,000	325,072,800	
１７２　２０年国債	480,000,000	458,884,800	
１７３　２０年国債	505,000,000	481,335,700	
１７４　２０年国債	510,000,000	484,617,300	
１７５　２０年国債	515,000,000	496,748,400	
１７６　２０年国債	610,000,000	586,661,400	

	１７７　２０年国債	540,000,000	508,302,000	
	１７８　２０年国債	500,000,000	478,390,000	
	１７９　２０年国債	580,000,000	553,702,800	
	国債証券　小計		109,049,192,830	
地方債証券	７２７　東京都公債	500,000,000	505,708,500	
	７９２　東京都公債	300,000,000	295,569,300	
	１　東京都３０年	100,000,000	120,100,100	
	８　東京都３０年	400,000,000	499,078,800	
	１３　東京都３０年	500,000,000	604,714,500	
	１　東京都２０年	100,000,000	101,799,100	
	６　東京都２０年	100,000,000	105,615,000	
	２４－１４　北海道公債	100,000,000	100,688,500	
	２６－１５　北海道公債	100,000,000	100,994,800	
	３０－１８　北海道公債	200,000,000	198,058,800	
	１　神奈川県２０年	100,000,000	105,422,900	
	３　神奈川県２０年	100,000,000	106,424,600	
	７　神奈川県２０年	100,000,000	110,230,300	
	１３　神奈川県２０年	100,000,000	114,447,000	
	３７３　大阪府公債	100,000,000	101,050,800	
	３７７　大阪府公債	100,000,000	101,067,200	
	３８８　大阪府公債	100,000,000	101,125,700	
	２７－４　京都府公債	100,000,000	101,469,700	
	２９－１２　京都府５年	300,000,000	300,091,200	
	１－６　京都府５年	200,000,000	199,655,200	
	５　兵庫県公債１５年	300,000,000	319,650,600	
	１０兵庫県公債２０年	100,000,000	114,850,600	
	７　静岡県３０年	100,000,000	122,243,000	
	１　静岡県２０年	100,000,000	107,136,200	
	２２－８　愛知県２０年	200,000,000	226,178,000	
	２７－１６　愛知県公債	400,000,000	405,132,000	
	２５－１１　福岡県公債	100,000,000	101,200,000	
	２６－３　福岡県公債	100,000,000	101,159,100	
	２６－１０　福岡県公債	100,000,000	101,062,500	
	１－１　福岡県公債	200,000,000	196,433,200	
	２５－８　千葉県公債	100,000,000	101,025,000	
	１１８　共同発行地方	100,000,000	100,647,800	
	１３７　共同発行地方	200,000,000	202,341,600	
	１３８　共同発行地方	200,000,000	202,349,600	
	１７２　共同発行地方	500,000,000	501,760,500	
	１８３　共同発行地方	600,000,000	599,347,200	
	１　名古屋市２０年	200,000,000	206,577,400	
	３　名古屋市２０年	100,000,000	106,167,100	
	５　名古屋市２０年	100,000,000	109,602,800	
	２９－５　京都市５年	100,000,000	100,030,100	
	１　京都市３０年	100,000,000	129,270,400	

	７　京都市２０年	100,000,000	113,711,100	
	２６－１７　神戸市公債	100,000,000	100,555,100	
	２６－３　横浜市公債	200,000,000	202,341,000	
	４　横浜市２０年	100,000,000	105,705,800	
	９　横浜市２０年	100,000,000	109,291,800	
	１４　横浜市２０年	100,000,000	112,488,400	
	４７　横浜市５年	100,000,000	100,020,500	
	２６－４　札幌市公債	100,000,000	101,039,200	
	２４－２　北九州市債	100,000,000	100,498,400	
	１－２　北九州市５年	100,000,000	99,816,200	
	２９－１１　福岡市５年	300,000,000	300,091,200	
	地方債証券　小計		9,573,035,400	
特殊債券	３　政保政策投資ＣＯ	200,000,000	207,191,200	
	３６　日本政策投資Ｂ	100,000,000	110,551,500	
	１８　道路機構	100,000,000	141,049,900	
	２２　道路機構	300,000,000	409,975,500	
	２７　道路機構	100,000,000	111,707,500	
	３７　道路機構	300,000,000	339,783,600	
	４７　道路機構	200,000,000	229,019,400	
	１０４　道路機構	400,000,000	402,592,800	
	７９　政保道路機構	200,000,000	226,626,000	
	８１　政保道路機構	200,000,000	226,940,400	
	８８　政保道路機構	100,000,000	126,661,100	
	９０　政保道路機構	500,000,000	569,495,500	
	９９　政保道路機構	100,000,000	115,229,300	
	１７６　政保道路機構	100,000,000	113,739,000	
	１９６　政保道路機構	100,000,000	115,761,900	
	２１０　政保道路機構	200,000,000	226,944,400	
	２２７　政保道路機構	200,000,000	202,722,600	
	２３１　政保道路機構	300,000,000	303,905,700	
	２８８　政保道路機構	189,000,000	188,562,276	
	９　道路債券	100,000,000	125,413,600	
	２　地方公営２０年	100,000,000	113,826,500	
	４５　地方公共団体	200,000,000	201,355,800	
	６１　地方公共団体	100,000,000	101,386,200	
	６２　地方公共団体	400,000,000	405,175,200	
	６３　地方公共団体	100,000,000	101,219,700	
	６７政保地方公共団	100,000,000	101,240,800	
	１０１　地方公共団体	100,000,000	100,214,300	
	１０６　地方公共団体	200,000,000	199,924,600	
	３　公営企業２０年	100,000,000	100,957,300	
	５　公営企業２０年	100,000,000	102,997,800	
	１７　公営企業２０年	100,000,000	108,926,200	
	２０　公営企業２０年	100,000,000	110,331,700	
	２２　公営企業２０年	100,000,000	111,115,100	

２４　公営企業２０年	200,000,000	224,690,400	
５２　住宅支援機構	100,000,000	113,599,600	
１３０　住宅支援機構	200,000,000	228,949,000	
２２６　住宅支援機構	100,000,000	100,134,800	
Ｓ９　住宅金融ＲＭＢＳ	20,640,000	20,834,016	
Ｓ１０住宅金融ＲＭＢＳ	31,836,000	32,109,789	
Ｓ３　住宅機構ＲＭＢＳ	11,144,000	11,327,876	
Ｓ５　住宅機構ＲＭＢＳ	23,666,000	24,189,018	
Ｓ７　住宅機構ＲＭＢＳ	12,205,000	12,468,628	
Ｓ９　住宅機構ＲＭＢＳ	12,367,000	12,699,672	
Ｓ１０　住宅機構ＲＭＢＳ	12,197,000	12,479,970	
Ｓ１１　住宅機構ＲＭＢＳ	13,073,000	13,503,101	
２９　住宅金融ＲＭＢＳ	10,032,000	10,102,224	
３２　住宅金融ＲＭＢＳ	11,073,000	11,209,197	
３５　住宅金融ＲＭＢＳ	11,822,000	12,047,800	
３９　住宅金融ＲＭＢＳ	10,766,000	10,915,647	
４１　住宅金融ＲＭＢＳ	11,525,000	11,790,075	
４３　住宅金融ＲＭＢＳ	22,070,000	22,473,881	
５１　住宅金融ＲＭＢＳ	10,506,000	10,597,402	
５３　住宅金融ＲＭＢＳ	11,419,000	11,672,501	
１　住宅機構ＲＭＢＳ	20,726,000	20,906,316	
２　住宅機構ＲＭＢＳ	23,390,000	23,979,428	
４　住宅機構ＲＭＢＳ	10,780,000	10,976,196	
６　住宅機構ＲＭＢＳ	10,721,000	10,900,040	
１９　住宅機構ＲＭＢＳ	15,880,000	16,648,592	
２４　住宅機構ＲＭＢＳ	32,450,000	34,241,240	
２６　住宅機構ＲＭＢＳ	50,523,000	53,155,248	
２７　住宅機構ＲＭＢＳ	18,258,000	19,260,364	
２８　住宅機構ＲＭＢＳ	20,026,000	21,201,526	
２９　住宅機構ＲＭＢＳ	22,104,000	23,481,079	
３０　住宅機構ＲＭＢＳ	22,033,000	23,421,079	
３２　住宅機構ＲＭＢＳ	43,162,000	45,535,910	
３５　住宅機構ＲＭＢＳ	21,904,000	23,139,385	
３６　住宅機構ＲＭＢＳ	21,275,000	22,402,575	
４３　住宅機構ＲＭＢＳ	26,914,000	28,348,516	
４６　住宅機構ＲＭＢＳ	21,342,000	22,485,931	
４８　住宅機構ＲＭＢＳ	40,284,000	42,354,597	
４９　住宅機構ＲＭＢＳ	20,570,000	21,547,075	
５１　住宅機構ＲＭＢＳ	45,364,000	47,477,962	
５５　住宅機構ＲＭＢＳ	60,218,000	62,867,592	
５７　住宅機構ＲＭＢＳ	29,469,000	30,774,476	
５８　住宅機構ＲＭＢＳ	33,387,000	34,889,415	
５９　住宅機構ＲＭＢＳ	64,350,000	67,335,840	
６０　住宅機構ＲＭＢＳ	101,619,000	106,222,340	
６１　住宅機構ＲＭＢＳ	33,618,000	34,992,976	

	６７　住宅機構ＲＭＢＳ	39,831,000	41,105,592	
	６９　住宅機構ＲＭＢＳ	81,038,000	84,344,350	
	７０　住宅機構ＲＭＢＳ	70,776,000	73,465,488	
	７３　住宅機構ＲＭＢＳ	40,325,000	42,010,585	
	９９　住宅機構ＲＭＢＳ	60,688,000	61,950,310	
	１２３　住宅機構ＲＭＢＳ	78,771,000	77,999,044	
	１２４　住宅機構ＲＭＢＳ	78,620,000	77,621,526	
	１２５　住宅機構ＲＭＢＳ	78,727,000	77,719,294	
	１２７　住宅機構ＲＭＢＳ	80,432,000	79,225,520	
	１２８　住宅機構ＲＭＢＳ	79,545,000	78,479,097	
	１２９　住宅機構ＲＭＢＳ	81,229,000	80,335,481	
	１３７　住宅機構ＲＭＢＳ	84,072,000	83,021,100	
	１６７　住宅機構ＲＭＢＳ	96,274,000	94,685,479	
	８５　中日本高速道	300,000,000	299,445,300	
	特殊債券　小計		9,360,292,837	
社債券	2 BPCE S.A.	200,000,000	200,466,800	
	２０　西日本高速道	100,000,000	101,051,000	
	２３　西日本高速道	100,000,000	101,167,900	
	１３　大和ハウス	100,000,000	100,167,200	
	３０　東レ	100,000,000	100,526,500	
	５６　住友化学	200,000,000	200,280,600	
	２４三菱ケミカルホールデイ	100,000,000	100,011,400	
	１６　日立製作所	100,000,000	101,272,600	
	２２　パナソニツク	100,000,000	99,470,200	
	９　ＴＤＫ	100,000,000	98,350,500	
	６３　三井物産	100,000,000	110,497,800	
	８　みずほコーポレート	100,000,000	111,254,000	
	１　三井住友ＦＧ劣後	100,000,000	100,906,700	
	８　住友信託　劣後	100,000,000	109,348,400	
	１　みずほＦＧ劣後	100,000,000	100,936,000	
	９　みずほ銀行劣後	100,000,000	109,443,800	
	１７　ＮＴＴファイナンス	200,000,000	199,208,000	
	７３　ホンダファイナンス	200,000,000	198,657,400	
	２　三菱ＨＣキヤピタル	200,000,000	199,075,400	
	１　野村ホールデイングス	100,000,000	99,923,500	
	５８　三菱地所	100,000,000	123,872,100	
	１３５　三菱地所	200,000,000	196,284,000	
	１０　東急	100,000,000	98,139,900	
	３８　京王電鉄	100,000,000	100,115,800	
	１１０東日本旅客鉄	100,000,000	115,097,500	
	１６９　東日本旅客鉄	200,000,000	194,508,800	
	４１　東海旅客鉄道	100,000,000	111,876,400	
	４２　東海旅客鉄道	100,000,000	113,142,800	
	４５　東京地下鉄	100,000,000	98,049,300	
	６４　阪急阪神ＨＬＤＧ	100,000,000	99,360,100	

	５４６　中部電力	200,000,000	194,672,200	
	５５３　中部電力	200,000,000	199,280,600	
	５０８　東北電力	200,000,000	199,455,200	
	４９６　九州電力	300,000,000	292,755,000	
	３８　東京電力パワー	100,000,000	100,381,900	
	４１　大阪瓦斯	200,000,000	195,580,600	
	７　フアーストリテイリング	100,000,000	100,287,500	
	社債券　小計		5,074,875,400	
合　計			133,057,396,467	

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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4月13日現在）	（2022年4月13日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	1,980,401,795	1,936,532,460
金銭信託	1,160,138,477	75,671,589
コール・ローン	601,251,271	2,902,715,751
株式	283,975,881,503	372,473,853,310
投資証券	6,632,679,127	9,939,902,140
派生商品評価勘定	67,211,947	71,064,623
未収入金	383,008	24,703,555
未収配当金	312,896,444	456,665,778
差入委託証拠金	1,307,692,251	1,059,785,844
流動資産合計	296,038,535,823	388,940,895,050
資産合計	296,038,535,823	388,940,895,050
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,068,399	45,750,848
前受金	65,838,580	-
未払解約金	390,760,813	582,876,494
未払利息	1,647	-
その他未払費用	3,865	2,331
流動負債合計	459,673,304	628,629,673
負債合計	459,673,304	628,629,673
純資産の部		
元本等		
元本	58,211,745,190	63,653,360,828
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	237,367,117,329	324,658,904,549
元本等合計	295,578,862,519	388,312,265,377

純資産合計	295,578,862,519	388,312,265,377
負債純資産合計	296,038,535,823	388,940,895,050

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2021年4月14日 至 2022年4月13日
１．有価証券の評価基準及び評価方法	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。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
２．デリバティブの評価基準及び評価方法	(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。 (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。
３．収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。
４．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

（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4月13日現在）	（2022年4月13日現在）
１．当計算期間の末日における受益権の総数	58,211,745,190口	63,653,360,828口

２．１単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　5.0776円 （１万口当たりの純資産額50,776円）	1口当たり純資産額　6.1004円 （１万口当たりの純資産額61,004円）

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	自 2021年4月14日 至 2022年4月13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。

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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	（2022年4月13日現在）
１．貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．時価の算定方法	(1) 有価証券（株式、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

（2021年4月13日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区　分	種　類	契　約　額　等		時　価	評価損益
			うち１年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建				
	SPMINI 2106	4,592,481,363	-	4,650,475,482	57,994,119
	SPI200 2106	186,653,370	-	188,352,645	1,699,275
	FTSE 2106	287,848,728	-	288,833,521	984,793
	DJ EUR 2106	980,286,606	-	985,446,999	5,160,393
	小計	6,047,270,067	-	6,113,108,647	65,838,580
合　計		6,047,270,067	-	6,113,108,647	65,838,580

（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	1,819,250,400	-	1,817,899,629	△1,350,771
	イギリス・ポンド	67,749,720	-	67,760,180	10,460
	イスラエル・シュケル	8,338,970	-	8,307,350	△31,620
	オーストラリア・ドル	50,940,280	-	50,873,685	△66,595
	カナダ・ドル	52,331,760	-	52,277,628	△54,132
	シンガポール・ドル	4,086,300	-	4,086,865	565
	スイス・フラン	55,755,930	-	55,771,231	15,301
	スウェーデン・クローナ	14,174,700	-	14,174,700	-
	デンマーク・クローネ	11,576,750	-	11,576,400	△350
	ニュージーランド・ドル	768,530	-	768,580	50
	ノルウェー・クローネ	3,742,570	-	3,741,000	△1,570
	ユーロ	294,957,980	-	294,752,440	△205,540
	香港・ドル	29,055,840	-	29,045,010	△10,830
	小計	2,412,729,730	-	2,411,034,698	△1,695,032
合　計		2,412,729,730	-	2,411,034,698	△1,695,032

（2022年4月13日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区　分	種　類	契　約　額　等	うち１年超	時　価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建				
	S&P 500 EMINI FUT JUN22	4,452,038,122	-	4,469,974,146	17,936,024
	SPI 200 FUTURES JUN22	227,121,578	-	225,741,568	△1,380,010
	FTSE 100 IDX FUT JUN22	253,714,065	-	258,682,481	4,968,416
	EURO STOXX 50 JUN22	827,655,257	-	831,268,867	3,613,610
	小計	5,760,529,022	-	5,785,667,062	25,138,040
合　計		5,760,529,022	-	5,785,667,062	25,138,040

（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	うち１年超	時　価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	1,614,573,000	-	1,615,438,478	865,478
	カナダ・ドル	77,408,760	-	77,506,260	97,500
	オーストラリア・ドル	29,774,720	-	29,938,976	164,256
	香港・ドル	17,783,310	-	17,792,967	9,657
	シンガポール・ドル	10,108,780	-	10,128,470	19,690
	イスラエル・シュケル	4,695,600	-	4,693,992	△1,608
	スイス・フラン	70,057,000	-	69,961,684	△95,316
	スウェーデン・クローナ	6,207,760	-	6,189,900	△17,860
	ユーロ	167,955,270	-	167,097,099	△858,171
	小計	1,998,564,200	-	1,998,747,826	183,626
	売建				

	ニュージーランド・ドル	3,421,480	-	3,439,880	△18,400
	イギリス・ポンド	6,539,120	-	6,528,612	10,508
	小計	9,960,600	-	9,968,492	△7,892
合　計		2,008,524,800	-	2,008,716,318	175,734

（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。

①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。

②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4月14日 至 2022年4月13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4月13日現在）	
開示対象ファンドの 期首における当該親投資信託の元本額	58,474,870,859円
同期中における追加設定元本額	16,974,480,468円
同期中における一部解約元本額	17,237,606,137円
2021年4月13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	28,675,405,235円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	283,051,086円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	1,207,524,235円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	838,459,709円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	70,282,809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）	1,307,216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）	6,549,259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）	20,430,761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）	51,182,329円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ）	48,571,646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）	96,727,490円
外国株式指数ファンド	587,742,940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	9,008,165,638円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	264,170,743円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	278,944,246円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	174,748,649円
イオン・バランス戦略ファンド	62,925,621円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	13,540,485円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	93,387,800円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	79,483,815円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	251,680,503円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	124,835,202円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	142,461,893円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	31,309,522円
三井住友ＤＳ・外国株式インデックス年金ファンド	182,400,691円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	3,651,079円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	13,766,131円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	11,796,950円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	1,957,599円
ＳＭＢＣ・ＤＣインデックスファンド（ＭＳＣＩコクサイ）	28,095,372円
ＳＭＡＭ・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	784,383,935円
バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	7,116,828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＞	42,227,299円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	931,142,266円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	1,030,755,411円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	4,447,927,100円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	13,987,860円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	76,827,086円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	602,644,828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＞	48,753,013円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	123,376,353円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	587,698,333円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	443,142,590円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	1,029,197,056円
ＳＭＡＭ・バランスＶＡ株４０Ｔ＜適格機関投資家限定＞	241,876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）	252,196,472円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	91,962,063円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	11,959,916円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	9,927,876円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	4,880,615円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	29,806,757円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	77,183,276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＞	196,801,861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＞	82,054,599円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	2,543,269,267円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	160,265,042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＞	1,441,122,783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＞	12,940,494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＞	34,488,574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＞	28,712,764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Ⅱ＜適格機関投資家限定＞	410,194,343円
合　計	58,211,745,190円

（2022年4月13日現在）

開示対象ファンドの 期首における当該親投資信託の元本額	58,211,745,190円
同期中における追加設定元本額	16,194,701,899円
同期中における一部解約元本額	10,753,086,261円

2022年4月13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	32,822,168,470円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	261,268,707円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	1,053,868,131円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	751,708,601円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	48,029,718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）	1,125,866円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２５（４資産タイプ）	5,678,753円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３０（４資産タイプ）	16,717,392円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５（４資産タイプ）	44,979,799円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ）	47,841,761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）	94,776,574円
外国株式指数ファンド	852,708,104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	14,465,738,967円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	96,142,646円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	103,195,277円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	68,329,125円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	15,569,633円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	122,523,866円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	105,362,465円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	367,489,080円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	192,799,695円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	222,706,458円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	43,921,433円
三井住友ＤＳ・外国株式インデックス年金ファンド	745,787,382円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	4,562,841円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	20,366,246円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	19,837,949円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	1,976,165円
ＳＭＢＣ・ＤＣインデックスファンド（ＭＳＣＩコクサイ）	170,769,804円
日興ＦＷＳ・先進国株インデックス（為替ヘッジあり）	162,944,584円
日興ＦＷＳ・先進国株インデックス（為替ヘッジなし）	544,987,952円
三井住友ＤＳ・先進国株式インデックス・ファンド	21,467,988円
ＳＭＡＭ・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	509,401,113円
バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	3,309,072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＞	25,733,245円

ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	627,813,023円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	773,029,117円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	3,346,842,453円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	10,889,499円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	56,580,424円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	451,874,051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＞	37,545,497円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	93,355,655円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	461,868,419円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	326,103,369円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	757,423,890円
ＳＭＡＭ・バランスＶＡ株４０Ｔ＜適格機関投資家限定＞	200,225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）	208,564,505円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	69,160,413円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	8,668,847円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	7,431,222円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	3,930,927円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	20,416,659円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	55,967,394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＞	121,991,477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＞	54,169,208円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	509,774,724円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	93,680,381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＞	1,402,985,029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＞	22,195,395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＞	14,310,453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＞	18,636,428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Ⅱ＜適格機関投資家限定＞	62,157,282円
合　計	63,653,360,828円

（３）附属明細表

①有価証券明細表

(a)株式

通　貨	銘　柄	株　数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	BAKER HUGHES CO	48,147	36.320	1,748,699.04	
	CHENIERE ENERGY INC	13,763	137.960	1,898,743.48	
	CHEVRON CORP	109,842	169.010	18,564,396.42	
	CONOCOPHILLIPS	75,728	100.000	7,572,800.00	
	COTERRA ENERGY INC	40,261	28.370	1,142,204.57	
	DEVON ENERGY CORP	36,196	62.260	2,253,562.96	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	9,236	139.180	1,285,466.48	
	EOG RESOURCES INC	33,177	124.570	4,132,858.89	

EXXON MOBIL CORP	240,058	85.600	20,548,964.80	
HALLIBURTON CO	48,780	39.530	1,928,273.40	
HESS CORP	15,806	112.600	1,779,755.60	
KINDER MORGAN INC	115,515	19.140	2,210,957.10	
MARATHON PETROLEUM CORP	33,933	85.800	2,911,451.40	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	54,615	59.140	3,229,931.10	
ONEOK INC	24,725	70.810	1,750,777.25	
PHILLIPS 66	28,293	81.970	2,319,177.21	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	13,151	252.530	3,321,022.03	
SCHLUMBERGER LTD	77,056	41.530	3,200,135.68	
VALERO ENERGY CORP	23,182	100.790	2,336,513.78	
WILLIAMS COS INC	71,708	34.790	2,494,721.32	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	12,372	247.780	3,065,534.16	
ALBEMARLE CORP	6,560	205.020	1,344,931.20	
AMCOR PLC	82,302	11.660	959,641.32	
AVERY DENNISON CORP	4,232	173.490	734,209.68	
BALL CORP	19,410	86.310	1,675,277.10	
CELANESE CORP	6,643	143.970	956,392.71	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,002	109.820	1,318,059.64	
CORTEVA INC	41,332	60.630	2,505,959.16	
CROWN HOLDINGS INC	6,863	118.620	814,089.06	
DOW INC	41,516	63.260	2,626,302.16	
DUPONT DE NEMOURS INC	27,944	68.460	1,913,046.24	
EASTMAN CHEMICAL CO	7,027	107.490	755,332.23	
ECOLAB INC	14,157	179.330	2,538,774.81	
FMC CORP	6,676	137.160	915,680.16	
FREEPORT-MCMORAN INC	85,156	48.000	4,087,488.00	
INTERNATIONAL PAPER CO	19,140	46.640	892,689.60	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	13,922	124.430	1,732,314.46	
LINDE PLC	29,358	314.000	9,218,412.00	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	16,010	103.530	1,657,515.30	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,559	366.650	1,304,907.35	
MOSAIC CO/THE	22,416	75.480	1,691,959.68	
NEWMONT CORP	46,400	82.500	3,828,000.00	
NUCOR CORP	16,292	157.240	2,561,754.08	
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,988	156.970	939,936.36	
PPG INDUSTRIES INC	13,502	128.710	1,737,842.42	
RPM INTERNATIONAL INC	7,696	85.750	659,932.00	
SEALED AIR CORP	7,895	67.000	528,965.00	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	14,500	256.950	3,725,775.00	
STEEL DYNAMICS INC	10,191	84.640	862,566.24	

VULCAN MATERIALS CO	7,555	175.500	1,325,902.50	
WESTROCK CO	13,034	47.880	624,067.92	
3M CO	32,676	148.580	4,855,000.08	
AERCAP HOLDINGS NV	8,330	48.760	406,170.80	
ALLEGION PLC	4,764	105.800	504,031.20	
AMETEK INC	13,117	128.690	1,688,026.73	
BOEING CO/THE	32,149	176.280	5,667,225.72	
CARRIER GLOBAL CORP	46,600	41.780	1,946,948.00	
CATERPILLAR INC	31,095	216.700	6,738,286.50	
CUMMINS INC	8,207	192.580	1,580,504.06	
DEERE & CO	16,702	419.730	7,010,330.46	
DOVER CORP	8,225	147.870	1,216,230.75	
EATON CORP PLC	23,221	140.820	3,269,981.22	
EMERSON ELECTRIC CO	34,129	92.820	3,167,853.78	
FASTENAL CO	32,763	57.690	1,890,097.47	
FORTIVE CORP	18,373	58.610	1,076,841.53	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	7,166	70.330	503,984.78	
GENERAC HOLDINGS INC	3,300	264.900	874,170.00	
GENERAL DYNAMICS CORP	13,847	243.820	3,376,175.54	
GENERAL ELECTRIC CO	63,295	90.000	5,696,550.00	
HEICO CORP	1,888	148.730	280,802.24	
HEICO CORP-CLASS A	4,570	122.840	561,378.80	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	39,519	190.990	7,547,733.81	
HOWMET AEROSPACE INC	19,024	34.680	659,752.32	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,107	209.970	442,406.79	
IDEX CORP	3,839	193.760	743,844.64	
ILLINOIS TOOL WORKS	18,247	199.810	3,645,933.07	
INGERSOLL-RAND INC	21,013	46.250	971,851.25	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	11,500	56.020	644,230.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	38,803	62.150	2,411,606.45	
KORNIT DIGITAL LTD	3,043	71.500	217,574.50	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	11,079	257.200	2,849,518.80	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,104	242.620	510,472.48	
LOCKHEED MARTIN CORP	14,287	467.550	6,679,886.85	
MASCO CORP	14,885	49.670	739,337.95	
NORDSON CORP	2,884	217.650	627,702.60	
NORTHROP GRUMMAN CORP	8,540	463.280	3,956,411.20	
OTIS WORLDWIDE CORP	22,881	75.890	1,736,439.09	
OWENS CORNING	5,205	84.630	440,499.15	

PACCAR INC	20,753	82.410	1,710,254.73	
PARKER HANNIFIN CORP	7,329	270.260	1,980,735.54	
PENTAIR PLC	8,220	52.620	432,536.40	
PLUG POWER INC	28,584	25.920	740,897.28	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	85,821	102.600	8,805,234.60	
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,219	262.910	1,635,037.29	
ROPER TECHNOLOGIES INC	6,180	470.500	2,907,690.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,600	47.900	364,040.00	
SMITH (A.O.) CORP	7,157	64.490	461,554.93	
SNAP-ON INC	3,106	210.560	653,999.36	
STANLEY BLACK & DECKER INC	9,129	140.280	1,280,616.12	
SUNRUN INC	10,669	25.620	273,339.78	
TEXTRON INC	11,803	67.680	798,827.04	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	12,759	146.910	1,874,424.69	
TRANSDIGM GROUP INC	3,010	636.510	1,915,895.10	
UNITED RENTALS INC	4,113	318.800	1,311,224.40	
WABTEC CORP	9,231	88.560	817,497.36	
WW GRAINGER INC	2,390	523.500	1,251,165.00	
XYLEM INC	10,225	84.850	867,591.25	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	8,029	87.570	703,099.53	
CINTAS CORP	5,169	415.770	2,149,115.13	
CLARIVATE PLC	19,939	16.200	323,011.80	
COPART INC	12,238	121.000	1,480,798.00	
COSTAR GROUP INC	23,804	62.290	1,482,751.16	
EQUIFAX INC	6,841	217.190	1,485,796.79	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,927	140.290	971,788.83	
LEIDOS HOLDINGS INC	6,947	108.300	752,360.10	
REPUBLIC SERVICES INC	12,824	133.910	1,717,261.84	
ROBERT HALF INTL INC	5,555	111.010	616,660.55	
ROLLINS INC	11,493	35.430	407,196.99	
TRANSUNION	11,233	93.110	1,045,904.63	
VERISK ANALYTICS INC	8,757	214.640	1,879,602.48	
WASTE CONNECTIONS INC	15,445	141.590	2,186,857.55	
WASTE MANAGEMENT INC	23,720	161.850	3,839,082.00	
AMERCO	650	547.570	355,920.50	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,925	101.410	702,264.25	
CSX CORP	128,276	34.410	4,413,977.16	
DELTA AIR LINES INC	8,299	38.620	320,507.38	
EXPEDITORS INTL WASH INC	8,689	96.740	840,573.86	

FEDEX CORP	14,310	204.380	2,924,677.80	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	65,402	3.400	222,366.80	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,411	168.230	742,062.53	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,940	45.610	362,143.40	
LYFT INC-A	13,145	33.450	439,700.25	
NORFOLK SOUTHERN CORP	13,579	258.720	3,513,158.88	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,539	260.000	1,440,140.00	
SOUTHWEST AIRLINES CO	7,076	42.820	302,994.32	
UBER TECHNOLOGIES INC	85,141	31.990	2,723,660.59	
UNION PACIFIC CORP	36,797	245.060	9,017,472.82	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	41,784	187.890	7,850,795.76	
APTIV PLC	15,307	110.860	1,696,934.02	
BORGWARNER INC	12,075	37.060	447,499.50	
FORD MOTOR CO	218,306	15.360	3,353,180.16	
GENERAL MOTORS CO	72,747	40.040	2,912,789.88	
LEAR CORP	3,736	129.980	485,605.28	
LUCID GROUP INC	21,730	21.290	462,631.70	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	9,269	38.150	353,612.35	
TESLA INC	48,490	986.950	47,857,205.50	
DR HORTON INC	18,162	71.660	1,301,488.92	
GARMIN LTD	8,444	111.820	944,208.08	
HASBRO INC	7,491	82.760	619,955.16	
LENNAR CORP-A	14,494	76.510	1,108,935.94	
LULULEMON ATHLETICA INC	6,481	376.160	2,437,892.96	
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	123.880	354,668.44	
NEWELL BRANDS INC	17,587	22.250	391,310.75	
NIKE INC -CL B	73,154	125.040	9,147,176.16	
NVR INC	173	4,352.020	752,899.46	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	15,071	23.710	357,333.41	
PULTEGROUP INC	13,075	41.810	546,665.75	
VF CORP	20,583	55.410	1,140,504.03	
WHIRLPOOL CORP	3,212	174.600	560,815.20	
AIRBNB INC-CLASS A	17,263	160.110	2,763,978.93	
ARAMARK	13,242	35.850	474,725.70	
BOOKING HOLDINGS INC	2,368	2,181.380	5,165,507.84	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	13,336	67.020	893,778.72	
CARNIVAL CORP	48,156	18.510	891,367.56	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,586	1,532.610	2,430,719.46	
DARDEN RESTAURANTS INC	7,606	130.540	992,887.24	
DOMINO'S PIZZA INC	2,121	388.570	824,156.97	

DRAFTKINGS INC - CL A	16,742	16.410	274,736.22	
EXPEDIA GROUP INC	8,061	178.610	1,439,775.21	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	15,836	144.880	2,294,319.68	
LAS VEGAS SANDS CORP	17,634	35.030	617,719.02	
MARRIOTT INTERNATIONAL - CL A	15,697	163.240	2,562,378.28	
MCDONALD'S CORP	42,751	249.170	10,652,266.67	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	9,746	6.540	63,738.84	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,198	39.550	877,930.90	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	11,890	78.780	936,694.20	
STARBUCKS CORP	67,557	79.790	5,390,373.03	
VAIL RESORTS INC	2,038	246.880	503,141.44	
WYNN RESORTS LTD	4,913	71.500	351,279.50	
YUM! BRANDS INC	17,414	119.890	2,087,764.46	
ADVANCE AUTO PARTS INC	3,426	221.880	760,160.88	
AMAZON.COM INC	25,910	3,015.750	78,138,082.50	
AUTOZONE INC	1,235	2,168.440	2,678,023.40	
BATH & BODY WORKS INC	15,400	48.890	752,906.00	
BEST BUY CO INC	12,132	93.230	1,131,066.36	
BURLINGTON STORES INC	3,391	207.710	704,344.61	
CARMAX INC	8,427	93.330	786,491.91	
CARVANA CO	4,496	100.780	453,106.88	
CHEWY INC - CLASS A	3,969	43.300	171,857.70	
DOLLAR GENERAL CORP	13,651	243.830	3,328,523.33	
DOLLAR TREE INC	12,839	167.180	2,146,424.02	
DOORDASH INC - A	5,953	104.420	621,612.26	
EBAY INC	35,551	54.240	1,928,286.24	
ETSY INC	7,168	112.950	809,625.60	
FIVERR INTERNATIONAL LTD	1,931	66.580	128,565.98	
GENUINE PARTS CO	7,406	131.690	975,296.14	
HOME DEPOT INC	59,526	306.290	18,232,218.54	
LKQ CORP	15,922	45.960	731,775.12	
LOWE'S COS INC	38,668	204.140	7,893,685.52	
MERCADOLIBRE INC	2,654	1,115.980	2,961,810.92	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,958	717.550	2,840,062.90	
POOL CORP	2,107	410.970	865,913.79	
ROSS STORES INC	21,189	102.190	2,165,303.91	
TARGET CORP	27,611	231.340	6,387,528.74	
TJX COMPANIES INC	66,779	62.830	4,195,724.57	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	6,117	236.690	1,447,832.73	
ULTA BEAUTY INC	2,765	405.900	1,122,313.50	

WAYFAIR INC- CLASS A	3,756	107.550	403,957.80	
COSTCO WHOLESALE CORP	25,216	581.360	14,659,573.76	
KROGER CO	38,955	58.750	2,288,606.25	
SYSCO CORP	30,220	84.570	2,555,705.40	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	40,703	44.230	1,800,293.69	
WALMART INC	87,595	153.230	13,422,181.85	
ALTRIA GROUP INC	105,961	54.910	5,818,318.51	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	32,763	95.070	3,114,778.41	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	16,130	68.240	1,100,711.20	
BUNGE LTD	7,174	119.300	855,858.20	
CAMPBELL SOUP CO	10,638	45.710	486,262.98	
COCA-COLA CO/THE	234,195	64.560	15,119,629.20	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	13,567	47.940	650,401.98	
CONAGRA BRANDS INC	24,639	35.090	864,582.51	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,881	248.830	2,209,859.23	
GENERAL MILLS INC	34,440	70.430	2,425,609.20	
HERSHEY CO/THE	8,265	226.020	1,868,055.30	
HORMEL FOODS CORP	14,939	53.330	796,696.87	
JM SMUCKER CO/THE	5,768	139.410	804,116.88	
KELLOGG CO	12,949	67.950	879,884.55	
KEURIG DR PEPPER INC	38,244	37.630	1,439,121.72	
KRAFT HEINZ CO/THE	38,438	41.120	1,580,570.56	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	13,084	102.040	1,335,091.36	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	9,629	53.670	516,788.43	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	80,596	63.670	5,131,547.32	
MONSTER BEVERAGE CORP	22,202	82.690	1,835,883.38	
PEPSICO INC	78,962	173.300	13,684,114.60	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	89,277	100.490	8,971,445.73	
TYSON FOODS INC-CL A	16,951	93.440	1,583,901.44	
CHURCH & DWIGHT CO INC	14,330	103.910	1,489,030.30	
CLOROX COMPANY	6,542	146.450	958,075.90	
COLGATE-PALMOLIVE CO	46,642	81.000	3,778,002.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	12,953	262.700	3,402,753.10	
KIMBERLY-CLARK CORP	19,856	125.940	2,500,664.64	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	137,834	159.010	21,916,984.34	
ABBOTT LABORATORIES	101,062	118.390	11,964,730.18	
ABIOMED INC	2,288	299.640	685,576.32	

ALIGN TECHNOLOGY INC	4,154	406.230	1,687,479.42	
AMERISOURCEBERGEN CORP	9,459	162.620	1,538,222.58	
ANTHEM INC	13,954	509.610	7,111,097.94	
BAXTER INTERNATIONAL INC	29,602	78.070	2,311,028.14	
BECTON DICKINSON AND CO	15,743	269.180	4,237,700.74	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	79,811	43.760	3,492,529.36	
CARDINAL HEALTH INC	15,114	63.300	956,716.20	
CENTENE CORP	31,798	85.810	2,728,586.38	
CERNER CORP	15,537	93.350	1,450,378.95	
CIGNA CORP	19,185	254.820	4,888,721.70	
COOPER COS INC/THE	2,771	402.850	1,116,297.35	
CVS HEALTH CORP	75,780	104.640	7,929,619.20	
DAVITA INC	4,138	119.220	493,332.36	
DENTSPLY SIRONA INC	11,864	48.450	574,810.80	
DEXCOM INC	5,440	490.430	2,667,939.20	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	36,200	120.840	4,374,408.00	
HCA HEALTHCARE INC	13,853	260.890	3,614,109.17	
HENRY SCHEIN INC	7,559	91.040	688,171.36	
HOLOGIC INC	13,592	76.500	1,039,788.00	
HUMANA INC	7,201	449.040	3,233,537.04	
IDEXX LABORATORIES INC	4,980	497.240	2,476,255.20	
INMODE LTD	4,416	31.790	140,384.64	
INSULET CORP	4,263	253.600	1,081,096.80	
INTUITIVE SURGICAL INC	20,553	277.850	5,710,651.05	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	5,783	268.660	1,553,660.78	
MASIMO CORP	2,941	137.450	404,240.45	
MCKESSON CORP	8,411	322.580	2,713,220.38	
MEDTRONIC PLC	77,105	110.580	8,526,270.90	
MOLINA HEALTHCARE INC	3,428	331.880	1,137,684.64	
NOVOCURE LTD	4,517	82.600	373,104.20	
QUEST DIAGNOSTICS INC	6,814	137.270	935,357.78	
RESMED INC	8,650	237.370	2,053,250.50	
STERIS PLC	5,282	246.520	1,302,118.64	
STRYKER CORP	18,845	262.420	4,945,304.90	
TELADOC HEALTH INC	7,496	66.770	500,507.92	
TELEFLEX INC	2,340	339.690	794,874.60	
UNITEDHEALTH GROUP INC	53,590	533.710	28,601,518.90	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,203	149.270	627,381.81	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	7,675	191.720	1,471,451.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	12,580	126.640	1,593,131.20	
10X GENOMICS INC-CLASS A	3,814	71.480	272,624.72	

ABBVIE INC	100,824	167.310	16,868,863.44	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	16,873	125.390	2,115,705.47	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,810	159.580	1,086,739.80	
AMGEN INC	32,328	250.040	8,083,293.12	
AVANTOR INC	30,428	30.360	923,794.08	
BIOGEN INC	7,987	208.060	1,661,775.22	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,080	82.590	749,917.20	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,220	558.240	681,052.80	
BIO-TECHNE CORP	1,991	412.750	821,785.25	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	127,148	76.550	9,733,179.40	
CATALENT INC	8,935	100.060	894,036.10	
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,577	286.650	738,697.05	
DANAHER CORP	36,787	280.740	10,327,582.38	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	20,811	25.830	537,548.13	
ELI LILLY & CO	46,434	308.080	14,305,386.72	
EXACT SCIENCES CORP	9,771	67.400	658,565.40	
GILEAD SCIENCES INC	72,708	61.630	4,480,994.04	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	11,582	112.420	1,302,048.44	
ILLUMINA INC	8,237	344.590	2,838,387.83	
INCYTE CORP	9,243	80.070	740,087.01	
IQVIA HOLDINGS INC	10,637	237.670	2,528,095.79	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,089	160.940	658,083.66	
JOHNSON & JOHNSON	149,808	179.900	26,950,459.20	
MERCK & CO. INC.	144,374	85.630	12,362,745.62	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,258	1,313.770	1,652,722.66	
MODERNA INC	20,087	159.500	3,203,876.50	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,186	98.010	410,269.86	
NOVAVAX INC	3,601	58.100	209,218.10	
PERKINELMER INC	6,979	161.260	1,125,433.54	
PFIZER INC	320,083	53.110	16,999,608.13	
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,867	715.790	4,199,539.93	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	18,344	41.810	766,962.64	
SEAGEN INC	7,790	142.230	1,107,971.70	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	60,344	10.150	612,491.60	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	22,503	570.940	12,847,862.82	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	14,163	281.150	3,981,927.45	
VIATRIS INC	63,072	10.670	672,978.24	

WATERS CORP	3,425	293.930	1,006,710.25	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	4,241	384.550	1,630,876.55	
ZOETIS INC	27,326	187.910	5,134,828.66	
BANK OF AMERICA CORP	419,938	39.170	16,448,971.46	
CITIGROUP INC	114,274	50.340	5,752,553.16	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	25,225	40.900	1,031,702.50	
FIFTH THIRD BANCORP	37,150	39.630	1,472,254.50	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	670	632.430	423,728.10	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	9,688	155.050	1,502,124.40	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	75,817	13.470	1,021,254.99	
JPMORGAN CHASE & CO	168,263	131.540	22,133,315.02	
KEYCORP	51,128	20.500	1,048,124.00	
M & T BANK CORP	10,715	160.480	1,719,543.20	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	24,474	179.750	4,399,201.50	
REGIONS FINANCIAL CORP	58,274	20.820	1,213,264.68	
SIGNATURE BANK	3,256	268.690	874,854.64	
SVB FINANCIAL GROUP	3,496	506.840	1,771,912.64	
TRUIST FINANCIAL CORP	74,318	52.690	3,915,815.42	
US BANCORP	78,364	50.820	3,982,458.48	
WEBSTER FINANCIAL CORP	9,600	49.550	475,680.00	
WELLS FARGO & CO	228,028	48.420	11,041,115.76	
ALLY FINANCIAL INC	20,139	42.970	865,372.83	
AMERICAN EXPRESS CO	37,834	175.540	6,641,380.36	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,380	287.940	1,837,057.20	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	19,982	55.510	1,109,200.82	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	44,547	47.650	2,122,664.55	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	74,178	349.740	25,943,013.72	
BLACKROCK INC	8,737	716.830	6,262,943.71	
BLACKSTONE INC	38,948	113.430	4,417,871.64	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	23,654	132.230	3,127,768.42	
CARLYLE GROUP INC/THE	10,094	42.680	430,811.92	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,661	117.760	666,639.36	
CME GROUP INC	20,739	236.030	4,895,026.17	
COINBASE GLOBAL INC - CLASS A	2,027	149.850	303,745.95	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	16,425	111.830	1,836,807.75	
EQUITABLE HOLDINGS INC	22,820	30.400	693,728.00	

FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,939	425.600	825,238.40	
FRANKLIN RESOURCES INC	14,298	25.770	368,459.46	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	3,159	34.210	108,069.39	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	19,406	319.780	6,205,650.68	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	32,658	124.830	4,076,698.14	
INVESCO LTD	18,328	21.110	386,904.08	
KKR & CO INC	28,569	55.500	1,585,579.50	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,912	273.950	523,792.40	
MOODY'S CORP	9,247	332.140	3,071,298.58	
MORGAN STANLEY	77,387	83.930	6,495,090.91	
MSCI INC	4,862	480.310	2,335,267.22	
NASDAQ INC	6,509	180.060	1,172,010.54	
NORTHERN TRUST CORP	11,023	113.500	1,251,110.50	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	9,639	108.180	1,042,747.02	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	9,737	11.430	111,293.91	
S&P GLOBAL INC	20,313	397.310	8,070,558.03	
SCHWAB (CHARLES) CORP	83,280	80.070	6,668,229.60	
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,481	57.930	317,514.33	
SOFI TECHNOLOGIES INC	27,739	7.480	207,487.72	
STATE STREET CORP	20,939	82.250	1,722,232.75	
SYNCHRONY FINANCIAL	32,112	36.870	1,183,969.44	
T ROWE PRICE GROUP INC	12,314	143.870	1,771,615.18	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	5,220	86.020	449,024.40	
UPSTART HOLDINGS INC	1,590	83.960	133,496.40	
AFLAC INC	34,185	64.890	2,218,264.65	
ALLEGHANY CORP	689	848.020	584,285.78	
ALLSTATE CORP	16,419	142.120	2,333,468.28	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,539	145.720	515,703.08	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	48,577	62.450	3,033,633.65	
AON PLC-CLASS A	12,782	329.290	4,208,984.78	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	20,476	47.690	976,500.44	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	12,291	180.250	2,215,452.75	
ASSURANT INC	3,114	185.980	579,141.72	
BROWN & BROWN INC	14,273	71.940	1,026,799.62	
CHUBB LTD	24,864	214.420	5,331,338.88	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	9,371	136.840	1,282,327.64	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,288	184.940	238,202.72	
EVEREST RE GROUP LTD	2,065	289.920	598,684.80	

FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	13,937	42.560	593,158.72	
GLOBE LIFE INC	6,373	101.440	646,477.12	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	18,331	74.410	1,364,009.71	
LINCOLN NATIONAL CORP	8,677	63.130	547,779.01	
LOEWS CORP	12,727	64.510	821,018.77	
MARKEL CORP	702	1,480.590	1,039,374.18	
MARSH & MCLENNAN COS	28,143	168.640	4,746,035.52	
METLIFE INC	39,703	70.160	2,785,562.48	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	14,124	72.980	1,030,769.52	
PROGRESSIVE CORP	32,839	115.300	3,786,336.70	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	20,728	115.550	2,395,120.40	
TRAVELERS COS INC/THE	14,464	184.940	2,674,972.16	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,823	232.460	1,586,074.58	
WR BERKLEY CORP	11,142	68.520	763,449.84	
CBRE GROUP INC - A	18,244	85.930	1,567,706.92	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	79,100	4.880	386,008.00	
ZILLOW GROUP INC - A	3,154	45.750	144,295.50	
ZILLOW GROUP INC - C	10,672	47.350	505,319.20	
ACCENTURE PLC-CL A	36,095	326.730	11,793,319.35	
ADOBE INC	27,186	426.770	11,602,169.22	
AFFIRM HOLDINGS INC	9,077	37.480	340,205.96	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	8,321	117.930	981,295.53	
ANSYS INC	4,983	291.160	1,450,850.28	
ASANA INC - CL A	4,435	34.350	152,342.25	
AUTODESK INC	12,331	196.140	2,418,602.34	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	23,443	231.060	5,416,739.58	
AVALARA INC	4,319	94.240	407,022.56	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	8,808	42.220	371,873.76	
BILL.COM HOLDINGS INC	4,158	200.540	833,845.32	
BLACK KNIGHT INC	7,623	66.270	505,176.21	
BLOCK INC	29,496	122.890	3,624,763.44	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	5,889	154.070	907,318.23	
CADENCE DESIGN SYS INC	15,400	153.370	2,361,898.00	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	6,979	61.390	428,440.81	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	5,880	140.860	828,256.80	
CITRIX SYSTEMS INC	6,490	100.930	655,035.70	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	14,179	113.920	1,615,271.68	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	29,348	86.090	2,526,569.32	
COUPA SOFTWARE INC	3,490	102.780	358,702.20	

CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	10,656	223.510	2,381,722.56	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,795	169.640	474,143.80	
DATADOG INC - CLASS A	11,914	135.500	1,614,347.00	
DOCUSIGN INC	12,031	98.760	1,188,181.56	
DROPBOX INC-CLASS A	16,584	22.470	372,642.48	
DYNATRACE INC	9,587	43.320	415,308.84	
EPAM SYSTEMS INC	3,095	298.130	922,712.35	
FAIR ISAAC CORP	1,494	407.400	608,655.60	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	33,940	101.940	3,459,843.60	
FISERV INC	33,818	98.970	3,346,967.46	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,371	250.740	1,095,984.54	
FORTINET INC	8,155	330.100	2,691,965.50	
GARTNER INC	4,568	289.470	1,322,298.96	
GLOBAL PAYMENTS INC	17,139	135.070	2,314,964.73	
GODADDY INC - CLASS A	8,905	82.490	734,573.45	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	4,731	90.870	429,905.97	
HUBSPOT INC	2,561	443.910	1,136,853.51	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	51,574	125.980	6,497,292.52	
INTUIT INC	15,449	461.620	7,131,567.38	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,915	200.730	785,857.95	
MASTERCARD INC - A	50,005	345.800	17,291,729.00	
MICROSOFT CORP	404,747	282.060	114,162,938.82	
MONGODB INC	3,155	414.070	1,306,390.85	
NORTONLIFELOCK INC	31,347	26.430	828,501.21	
OKTA INC	8,044	143.360	1,153,187.84	
ORACLE CORP	94,141	79.330	7,468,205.53	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	98,735	12.460	1,230,238.10	
PALO ALTO NETWORKS INC	5,746	611.890	3,515,919.94	
PAYCHEX INC	17,729	136.590	2,421,604.11	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,007	317.450	954,572.15	
PAYPAL HOLDINGS INC	64,104	108.250	6,939,258.00	
PTC INC	5,462	100.560	549,258.72	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,992	108.060	431,375.52	
SALESFORCE INC	55,955	194.810	10,900,593.55	
SERVICENOW INC	11,453	510.210	5,843,435.13	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	11,562	210.940	2,438,888.28	
SPLUNK INC	9,792	130.510	1,277,953.92	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	11,546	70.990	819,650.54	

SYNOPSYS INC	8,565	310.830	2,662,258.95	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	24,100	65.840	1,586,744.00	
TWILIO INC - A	8,993	144.840	1,302,546.12	
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,406	412.230	991,825.38	
UNITY SOFTWARE INC	2,853	90.080	256,998.24	
VERISIGN INC	5,227	213.340	1,115,128.18	
VISA INC-CLASS A SHARES	95,103	211.400	20,104,774.20	
VMWARE INC-CLASS A	12,723	111.790	1,422,304.17	
WESTERN UNION CO	21,840	18.630	406,879.20	
WIX.COM LTD	3,194	93.940	300,044.36	
WORKDAY INC-CLASS A	10,736	225.970	2,426,013.92	
ZENDESK INC	6,067	123.380	748,546.46	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	12,049	106.580	1,284,182.42	
ZSCALER INC	4,551	223.000	1,014,873.00	
AMPHENOL CORP-CL A	35,157	71.800	2,524,272.60	
APPLE INC	930,837	167.660	156,064,131.42	
ARISTA NETWORKS INC	12,952	127.420	1,650,343.84	
ARROW ELECTRONICS INC	4,130	107.940	445,792.20	
CDW CORP/DE	7,404	171.650	1,270,896.60	
CISCO SYSTEMS INC	240,838	51.820	12,480,225.16	
COGNEX CORP	8,698	70.830	616,079.34	
CORNING INC	45,688	33.550	1,532,832.40	
DELL TECHNOLOGIES -C	14,550	47.100	685,305.00	
F5 INC	3,921	206.080	808,039.68	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	71,283	15.410	1,098,471.03	
HP INC	65,388	37.890	2,477,551.32	
IPG PHOTONICS CORP	1,776	99.270	176,303.52	
JUNIPER NETWORKS INC	17,460	34.220	597,481.20	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	11,039	146.660	1,618,979.74	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	9,212	232.370	2,140,592.44	
NETAPP INC	13,273	76.390	1,013,924.47	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	11,800	83.150	981,170.00	
TE CONNECTIVITY LTD	19,220	123.400	2,371,748.00	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,844	477.650	1,358,436.60	
TRIMBLE INC	12,759	69.590	887,898.81	
WESTERN DIGITAL CORP	18,492	47.500	878,370.00	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	3,257	402.210	1,309,997.97	
ADVANCED MICRO DEVICES	93,559	95.100	8,897,460.90	
ANALOG DEVICES INC	30,985	155.500	4,818,167.50	

APPLIED MATERIALS INC	51,912	114.560	5,947,038.72	
BROADCOM INC	23,489	585.070	13,742,709.23	
ENPHASE ENERGY INC	7,293	185.950	1,356,133.35	
ENTEGRIS INC	7,892	110.310	870,566.52	
INTEL CORP	232,509	46.500	10,811,668.50	
KLA CORP	8,854	330.250	2,924,033.50	
LAM RESEARCH CORP	7,779	467.000	3,632,793.00	
MARVELL TECHNOLOGY INC	45,111	60.130	2,712,524.43	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	30,238	65.470	1,979,681.86	
MICRON TECHNOLOGY INC	64,636	71.960	4,651,206.56	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,676	401.040	1,073,183.04	
NVIDIA CORP	142,103	215.040	30,557,829.12	
NXP SEMICONDUCTORS NV	14,457	166.230	2,403,187.11	
ON SEMICONDUCTOR	24,630	53.140	1,308,838.20	
QORVO INC	6,042	114.100	689,392.20	
QUALCOMM INC	64,123	136.090	8,726,499.07	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,757	120.340	1,053,817.38	
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	2,634	301.450	794,019.30	
TERADYNE INC	8,542	108.180	924,073.56	
TEXAS INSTRUMENTS INC	52,879	173.000	9,148,067.00	
AT&T INC	408,894	19.560	7,997,966.64	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	21,079	25.520	537,936.08	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	8,432	24.970	210,547.04	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	49,758	11.400	567,241.20	
T-MOBILE US INC	36,145	131.440	4,750,898.80	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	236,606	53.670	12,698,644.02	
AES CORP	33,656	24.450	822,889.20	
ALLIANT ENERGY CORP	13,644	64.630	881,811.72	
AMEREN CORPORATION	14,760	96.750	1,428,030.00	
AMERICAN ELECTRIC POWER	27,967	102.310	2,861,303.77	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	10,241	168.550	1,726,120.55	
ATMOS ENERGY CORP	6,965	120.200	837,193.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	37,091	32.250	1,196,184.75	
CMS ENERGY CORP	16,996	72.830	1,237,818.68	
CONSOLIDATED EDISON INC	21,051	97.800	2,058,787.80	
CONSTELLATION ENERGY	18,329	61.870	1,134,015.23	
DOMINION ENERGY INC	47,030	87.390	4,109,951.70	
DTE ENERGY COMPANY	10,536	137.850	1,452,387.60	
DUKE ENERGY CORP	44,466	115.420	5,132,265.72	
EDISON INTERNATIONAL	21,701	71.880	1,559,867.88	

ENTERGY CORP	10,866	123.310	1,339,886.46	
ESSENTIAL UTILITIES INC	13,909	51.070	710,332.63	
EVERGY INC	14,377	71.350	1,025,798.95	
EVERSOURCE ENERGY	19,764	92.840	1,834,889.76	
EXELON CORP	54,987	48.050	2,642,125.35	
FIRSTENERGY CORP	31,966	47.140	1,506,877.24	
NEXTERA ENERGY INC	112,369	83.890	9,426,635.41	
NISOURCE INC	18,919	32.110	607,489.09	
NRG ENERGY INC	13,547	38.870	526,571.89	
P G & E CORP	76,538	12.530	959,021.14	
PPL CORP	39,561	28.830	1,140,543.63	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	27,231	71.920	1,958,453.52	
SEMPRA ENERGY	18,666	169.630	3,166,313.58	
SOUTHERN CO/THE	61,390	75.540	4,637,400.60	
UGI CORP	10,588	35.970	380,850.36	
VISTRA CORP	25,777	24.050	619,936.85	
WEC ENERGY GROUP INC	18,827	104.410	1,965,727.07	
XCEL ENERGY INC	29,237	74.730	2,184,881.01	
ACTIVISION BLIZZARD INC	43,065	79.540	3,425,390.10	
ALPHABET INC-CL A	17,091	2,554.290	43,655,370.39	
ALPHABET INC-CL C	16,249	2,567.490	41,719,145.01	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	27,658	17.420	481,802.36	
CABLE ONE INC	246	1,440.620	354,392.52	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,002	549.120	3,844,938.24	
COMCAST CORP-CLASS A	260,545	47.250	12,310,751.25	
DISH NETWORK CORP-A	12,937	31.780	411,137.86	
ELECTRONIC ARTS INC	15,352	123.570	1,897,046.64	
FOX CORP - CLASS A	16,962	38.840	658,804.08	
FOX CORP - CLASS B	8,773	35.610	312,406.53	
IAC/INTERACTIVECORP	3,974	99.720	396,287.28	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	19,626	33.870	664,732.62	
LIBERTY BROADBAND-A	1,312	132.500	173,840.00	
LIBERTY BROADBAND-C	8,196	137.330	1,125,556.68	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	10,288	67.530	694,748.64	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	4,141	45.000	186,345.00	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	7,648	45.010	344,236.48	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	8,770	108.340	950,141.80	

	MATCH GROUP INC	15,249	94.130	1,435,388.37	
	META PLATFORMS INC-CLASS A	134,599	214.140	28,823,029.86	
	NETFLIX INC	25,368	344.100	8,729,128.80	
	NEWS CORP - CLASS A	23,102	20.960	484,217.92	
	OMNICOM GROUP	12,545	77.920	977,506.40	
	PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	32,381	36.060	1,167,658.86	
	PINTEREST INC- CLASS A	28,563	22.680	647,808.84	
	ROKU INC	6,012	113.580	682,842.96	
	SEA LTD-ADR	18,531	108.800	2,016,172.80	
	SIRIUS XM HOLDINGS INC	67,656	6.520	441,117.12	
	SNAP INC - A	64,099	33.570	2,151,803.43	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	7,149	138.360	989,135.64	
	TWITTER INC	45,558	44.480	2,026,419.84	
	WALT DISNEY CO/THE	103,753	130.840	13,575,042.52	
	WARNER BROS DISCOVERY INC	123,410	24.680	3,045,758.80	
	ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	15,382	54.360	836,165.52	
アメリカ・ドル小計		18,020,800		2,173,644,264.68 (273,053,192,529)	
カナダ・ドル	CAMECO CORP	18,890	39.110	738,787.90	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	68,240	81.500	5,561,560.00	
	CENOVUS ENERGY INC	75,060	21.590	1,620,545.40	
	ENBRIDGE INC	116,715	58.320	6,806,818.80	
	IMPERIAL OIL LTD	12,999	64.700	841,035.30	
	KEYERA CORP	11,374	33.980	386,488.52	
	PARKLAND CORP	7,666	36.750	281,725.50	
	PEMBINA PIPELINE CORP	32,172	49.330	1,587,044.76	
	SUNCOR ENERGY INC	85,505	41.360	3,536,486.80	
	TC ENERGY CORP	53,918	72.180	3,891,801.24	
	TOURMALINE OIL CORP	16,638	60.790	1,011,424.02	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	27,243	82.020	2,234,470.86	
	BARRICK GOLD CORP	102,105	32.170	3,284,717.85	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	8,705	57.000	496,185.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	31,672	39.860	1,262,445.92	
	FRANCO-NEVADA CORP	11,432	208.310	2,381,399.92	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	32,698	11.520	376,680.96	
	KINROSS GOLD CORP	63,501	7.750	492,132.75	
	LUNDIN MINING CORP	46,446	12.840	596,366.64	
	NUTRIEN LTD	33,270	137.570	4,576,953.90	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	11,763	36.810	432,996.03	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	24,814	50.730	1,258,814.22	

WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,438	95.680	424,627.84	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	24,335	63.320	1,540,892.20	
BALLARD POWER SYSTEMS INC	17,008	13.110	222,974.88	
CAE INC	17,963	32.160	577,690.08	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,843	119.070	457,586.01	
WSP GLOBAL INC	6,141	158.180	971,383.38	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	9,913	41.000	406,433.00	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	5,667	72.100	408,590.70	
THOMSON REUTERS CORP	9,710	134.080	1,301,916.80	
AIR CANADA	12,083	22.220	268,484.26	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	40,807	155.210	6,333,654.47	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	53,134	94.530	5,022,757.02	
TFI INTERNATIONAL INC	5,097	103.840	529,272.48	
MAGNA INTERNATIONAL INC	16,331	76.740	1,253,240.94	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,066	44.200	400,717.20	
RESTAURANT BRANDS INTERN	17,686	74.630	1,319,906.18	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	3,001	191.130	573,581.13	
DOLLARAMA INC	17,025	72.650	1,236,866.25	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	48,248	56.670	2,734,214.16	
EMPIRE CO LTD 'A'	9,148	45.090	412,483.32	
LOBLAW COMPANIES LTD	8,683	118.110	1,025,549.13	
METRO INC/CN	13,109	72.950	956,301.55	
WESTON (GEORGE) LTD	4,984	160.930	802,075.12	
SAPUTO INC	13,425	30.310	406,911.75	
BAUSCH HEALTH COS INC	16,447	28.370	466,601.39	
CANOPY GROWTH CORP	11,251	8.560	96,308.56	
BANK OF MONTREAL	36,684	143.110	5,249,847.24	
BANK OF NOVA SCOTIA	68,902	85.750	5,908,346.50	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	26,066	145.080	3,781,655.28	
NATIONAL BANK OF CANADA	19,626	93.730	1,839,544.98	
ROYAL BANK OF CANADA	80,808	136.450	11,026,251.60	
TORONTO-DOMINION BANK	104,525	94.590	9,887,019.75	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	80,030	68.050	5,446,041.50	
IGM FINANCIAL INC	4,949	42.400	209,837.60	
ONEX CORPORATION	4,217	81.030	341,703.51	
TMX GROUP LTD	3,142	129.400	406,574.80	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,393	685.390	954,748.27	

	GREAT-WEST LIFECO INC	14,200	36.910	524,122.00	
	IA FINANCIAL CORP INC	4,851	74.190	359,895.69	
	INTACT FINANCIAL CORP	10,095	182.900	1,846,375.50	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	110,844	26.760	2,966,185.44	
	POWER CORP OF CANADA	31,768	38.720	1,230,056.96	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	33,220	69.980	2,324,735.60	
	FIRSTSERVICE CORP	2,516	171.620	431,795.92	
	BLACKBERRY LTD	25,993	8.460	219,900.78	
	CGI INC	11,493	101.890	1,171,021.77	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,098	2,177.000	2,390,346.00	
	LIGHTSPEED COMMERCE INC	6,363	31.030	197,443.89	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	5,042	82.540	416,166.68	
	OPEN TEXT CORP	15,337	53.420	819,302.54	
	SHOPIFY INC - CLASS A	6,582	747.230	4,918,267.86	
	BCE INC	5,509	72.850	401,330.65	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	20,818	73.800	1,536,368.40	
	TELUS CORP	15,222	33.430	508,871.46	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	44,154	19.830	875,573.82	
	ALTAGAS LTD	17,347	30.470	528,563.09	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	6,336	50.350	319,017.60	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	7,344	39.640	291,116.16	
	EMERA INC	14,279	64.660	923,280.14	
	FORTIS INC	25,895	64.510	1,670,486.45	
	HYDRO ONE LTD	18,821	35.370	665,698.77	
	NORTHLAND POWER INC	10,870	39.890	433,604.30	
	QUEBECOR INC -CL B	9,953	31.610	314,614.33	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	27,232	39.060	1,063,681.92	
カナダ・ドル小計		2,224,893		148,207,296.84 (14,727,359,087)	
オーストラリア・ドル	AMPOL LTD	10,927	31.680	346,167.36	
	SANTOS LTD	182,883	8.000	1,463,064.00	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	14,025	28.100	394,102.50	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	54,981	32.060	1,762,690.86	
	BHP GROUP LTD	287,051	51.720	14,846,277.72	
	BLUESCOPE STEEL LTD	25,462	21.260	541,322.12	
	EVOLUTION MINING LTD	84,420	4.500	379,890.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	88,448	21.170	1,872,444.16	

JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	26,108	40.670	1,061,812.36	
MINERAL RESOURCES LTD	11,662	59.160	689,923.92	
NEWCREST MINING LTD	54,082	27.860	1,506,724.52	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	65,844	10.820	712,432.08	
ORICA LTD	17,981	15.990	287,516.19	
RIO TINTO LTD	21,049	118.090	2,485,676.41	
SOUTH32 LTD	276,348	5.050	1,395,557.40	
REECE LTD	19,309	17.020	328,639.18	
BRAMBLES LTD	74,638	9.850	735,184.30	
AURIZON HOLDINGS LTD	94,440	3.790	357,927.60	
QANTAS AIRWAYS LTD	45,831	5.080	232,821.48	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	30,749	32.810	1,008,874.69	
CROWN RESORTS LTD	21,863	12.810	280,065.03	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,794	79.800	302,761.20	
IDP EDUCATION LTD	10,940	27.320	298,880.80	
TABCORP HOLDINGS LTD	139,785	5.360	749,247.60	
WESFARMERS LTD	65,345	47.960	3,133,946.20	
COLES GROUP LTD	79,056	18.340	1,449,887.04	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	65,607	7.670	503,205.69	
WOOLWORTHS GROUP LTD	69,646	38.120	2,654,905.52	
TREASURY WINE ESTATES LTD	36,464	11.150	406,573.60	
COCHLEAR LTD	4,095	222.420	910,809.90	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,446	64.310	607,472.26	
SONIC HEALTHCARE LTD	24,258	35.020	849,515.16	
CSL LTD	27,463	261.970	7,194,482.11	
AUST AND NZ BANKING GROUP	156,874	27.420	4,301,485.08	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	97,957	106.710	10,452,991.47	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	187,025	32.940	6,160,603.50	
WESTPAC BANKING CORP	213,258	24.140	5,148,048.12	
ASX LTD	11,180	82.500	922,350.00	
MACQUARIE GROUP LTD	18,953	203.130	3,849,922.89	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	117,187	4.290	502,732.23	
MEDIBANK PRIVATE LTD	128,724	3.110	400,331.64	
QBE INSURANCE GROUP LTD	80,863	11.760	950,948.88	
SUNCORP GROUP LTD	63,933	11.000	703,263.00	
COMPUTERSHARE LTD	33,563	25.210	846,123.23	
WISETECH GLOBAL LTD	7,909	47.340	374,412.06	
XERO LTD	7,459	101.170	754,627.03	

	TELSTRA CORP LTD	254,603	4.020	1,023,504.06	
	ORIGIN ENERGY LTD	117,278	6.440	755,270.32	
	REA GROUP LTD	2,833	129.700	367,440.10	
	SEEK LTD	17,266	28.190	486,728.54	
	オーストラリア・ドル小計	3,560,865		89,751,583.11 (8,397,158,116)	
香港・ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	153,924	56.400	8,681,313.60	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	83,000	109.700	9,105,100.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	94,000	17.740	1,667,560.00	
	MTR CORP	84,500	41.700	3,523,650.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	70,000	26.700	1,869,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	118,000	45.300	5,345,400.00	
	SANDS CHINA LTD	142,400	17.880	2,546,112.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	117,000	13.180	1,542,060.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	89,600	19.980	1,790,208.00	
	WH GROUP LTD	581,500	5.160	3,000,540.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	187,500	30.250	5,671,875.00	
	HANG SENG BANK LTD	48,200	151.200	7,287,840.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	67,100	343.400	23,042,140.00	
	AIA GROUP LTD	694,800	80.850	56,174,580.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	126,924	54.000	6,853,896.00	
	ESR CAYMAN LTD	102,000	23.250	2,371,500.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	98,000	16.140	1,581,720.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	83,384	32.950	2,747,502.80	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	84,833	31.500	2,672,239.50	
	SINO LAND CO	248,200	10.620	2,635,884.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	68,000	93.450	6,354,600.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	27,000	45.100	1,217,700.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	53,000	20.000	1,060,000.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	91,000	38.150	3,471,650.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	41,000	53.350	2,187,350.00	
	CLP HOLDINGS LTD	94,100	77.050	7,250,405.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	606,389	9.120	5,530,267.68	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	71,500	52.050	3,721,575.00	

香港・ドル小計		4,326,854		180,903,668.58 (2,899,885,807)	
シンガポール・ドル	KEPPEL CORP LTD	70,500	6.550	461,775.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	108,600	4.060	440,916.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	77,966	5.350	417,118.10	
	GENTING SINGAPORE LTD	327,500	0.800	262,000.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	103,200	4.610	475,752.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	102,000	33.240	3,390,480.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	202,300	12.010	2,429,623.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	64,700	31.100	2,012,170.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,800	9.900	423,720.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	136,600	4.020	549,132.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	25,800	8.200	211,560.00	
	UOL GROUP LTD	30,900	7.080	218,772.00	
	VENTURE CORP LTD	15,700	17.050	267,685.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	439,815	2.610	1,147,917.15	
シンガポール・ドル小計		1,748,381		12,708,620.25 (1,170,209,753)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	70,711	7.505	530,686.05	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	31,250	23.000	718,750.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	24,028	9.100	218,654.80	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	113,841	4.780	544,159.98	
	MERCURY NZ LTD	26,913	5.970	160,670.61	
	MERIDIAN ENERGY LTD	66,454	4.900	325,624.60	
ニュージーランド・ドル小計		333,197		2,498,546.04 (214,874,958)	
イギリス・ポンド	BP PLC	1,097,928	3.959	4,346,696.95	
	SHELL PLC	439,968	21.655	9,527,507.04	
	ANGLO AMERICAN PLC	70,253	41.005	2,880,724.26	
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	16.785	326,283.61	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,838	77.280	605,720.64	
	GLENCORE PLC	576,604	5.248	3,026,017.79	
	JOHNSON MATTHEY PLC	10,074	19.050	191,909.70	
	MONDI PLC	25,128	14.270	358,576.56	
	RIO TINTO PLC	64,866	61.540	3,991,853.64	
	ASHTEAD GROUP PLC	23,686	45.820	1,085,292.52	
	BAE SYSTEMS PLC	189,839	7.716	1,464,797.72	
	BUNZL PLC	17,064	30.900	527,277.60	
	DCC PLC	5,954	57.860	344,498.44	

FERGUSON PLC	12,017	97.700	1,174,060.90	
MELROSE INDUSTRIES PLC	221,714	1.189	263,617.94	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	494,144	0.897	443,247.16	
SMITHS GROUP PLC	24,369	14.070	342,871.83	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	4,459	124.100	553,361.90	
EXPERIAN PLC	54,749	27.530	1,507,239.97	
INTERTEK GROUP PLC	8,184	50.820	415,910.88	
RELX PLC	106,284	24.070	2,558,255.88	
RENTOKIL INITIAL PLC	112,603	5.298	596,570.69	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,766	5.128	332,120.04	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,637	40.010	265,546.37	
BURBERRY GROUP PLC	26,233	15.945	418,285.18	
PERSIMMON PLC	16,916	21.830	369,276.28	
TAYLOR WIMPEY PLC	225,588	1.324	298,678.51	
COMPASS GROUP PLC	97,177	16.440	1,597,589.88	
ENTAIN PLC	37,600	15.370	577,912.00	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	9,587	48.950	469,283.65	
WHITBREAD PLC	11,282	28.080	316,798.56	
JD SPORTS FASHION PLC	144,300	1.474	212,698.20	
KINGFISHER PLC	109,678	2.607	285,930.54	
NEXT PLC	6,860	61.400	421,204.00	
OCADO GROUP PLC	27,379	11.845	324,304.25	
SAINSBURY (J) PLC	113,480	2.446	277,572.08	
TESCO PLC	439,670	2.706	1,189,747.02	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	16,771	16.330	273,870.43	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	125,847	32.700	4,115,196.90	
COCA-COLA HBC AG-DI	8,704	15.620	135,956.48	
DIAGEO PLC	134,031	39.655	5,314,999.30	
IMPERIAL BRANDS PLC	50,003	16.780	839,050.34	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	40,047	58.460	2,341,147.62	
UNILEVER PLC	147,693	34.320	5,068,823.76	
NMC HEALTH PLC	3,940	0.010	39.40	
SMITH & NEPHEW PLC	44,355	12.115	537,360.82	
ASTRAZENECA PLC	88,548	105.040	9,301,081.92	
GLAXOSMITHKLINE PLC	289,657	17.838	5,166,901.56	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	7,581	20.660	156,623.46	
BARCLAYS PLC	904,741	1.432	1,295,589.11	
HSBC HOLDINGS PLC	1,167,394	5.193	6,062,277.04	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,178,120	0.441	1,842,550.92	

	NATWEST GROUP PLC	316,287	2.160	683,179.92	
	STANDARD CHARTERED PLC	146,561	5.014	734,856.85	
	3I GROUP PLC	49,338	13.200	651,261.60	
	ABRDN PLC	123,263	2.026	249,730.83	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	19,572	10.015	196,013.58	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	17,716	81.700	1,447,397.20	
	M&G PLC	133,064	2.136	284,224.70	
	SCHRODERS PLC	6,213	31.780	197,449.14	
	ST JAMES'S PLACE PLC	33,823	13.910	470,477.93	
	ADMIRAL GROUP PLC	11,535	25.120	289,759.20	
	AVIVA PLC	229,027	4.289	982,296.80	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	313,637	2.714	851,210.81	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	36,851	6.208	228,771.00	
	PRUDENTIAL PLC	161,840	10.655	1,724,405.20	
	AVEVA GROUP PLC	6,037	24.400	147,302.80	
	SAGE GROUP PLC/THE	55,987	7.182	402,098.63	
	HALMA PLC	24,375	24.450	595,968.75	
	BT GROUP PLC	545,432	1.937	1,056,501.78	
	VODAFONE GROUP PLC	1,546,057	1.306	2,019,150.44	
	NATIONAL GRID PLC	199,260	11.940	2,379,164.40	
	SEVERN TRENT PLC	12,418	30.610	380,114.98	
	SSE PLC	64,516	17.835	1,150,642.86	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	42,035	11.400	479,199.00	
	AUTO TRADER GROUP PLC	51,319	6.382	327,517.85	
	INFORMA PLC	78,152	6.074	474,695.24	
	PEARSON PLC	39,623	7.794	308,821.66	
	WPP PLC	63,987	9.718	621,825.66	
イギリス・ポンド小計		16,459,674		105,674,748.05 (17,248,232,377)	
イスラエル・シュケル	ICL GROUP LTD	41,773	38.080	1,590,715.84	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,389	696.000	966,744.00	
	BANK HAPOALIM BM	66,403	31.600	2,098,334.80	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	77,079	34.670	2,672,328.93	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	54,674	19.990	1,092,933.26	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	9,249	124.900	1,155,200.10	
	AZRIELI GROUP LTD	2,140	278.500	595,990.00	
	NICE LTD	3,251	695.100	2,259,770.10	
イスラエル・シュケル小計		255,958		12,432,017.03 (486,295,751)	
スイス・フラン	CLARIANT AG-REG	10,101	15.560	157,171.56	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	356	865.000	307,940.00	

GIVAUDAN-REG	521	3,852.000	2,006,892.00	
HOLCIM LTD	31,603	42.880	1,355,136.64	
SIKA AG-REG	7,800	306.900	2,393,820.00	
ABB LTD-REG	96,015	29.050	2,789,235.75	
GEBERIT AG-REG	1,986	550.800	1,093,888.80	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	941	188.600	177,472.60	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,132	190.400	405,932.80	
VAT GROUP AG	1,436	319.400	458,658.40	
ADECCO GROUP AG-REG	9,118	38.980	355,419.64	
SGS SA-REG	374	2,525.000	944,350.00	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,981	256.200	763,732.20	
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	30,335	116.500	3,534,027.50	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,716	249.500	428,142.00	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	2,516	47.740	120,113.84	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	216	2,256.000	487,296.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	59	11,140.000	657,260.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	6	114,300.000	685,800.00	
NESTLE SA-REG	160,218	122.840	19,681,179.12	
ALCON INC	29,513	75.060	2,215,245.78	
SONOVA HOLDING AG-REG	3,269	377.000	1,232,413.00	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	531	1,304.500	692,689.50	
BACHEM HOLDING AG-REG B	322	502.000	161,644.00	
LONZA GROUP AG-REG	4,343	666.400	2,894,175.20	
NOVARTIS AG-REG	125,305	86.670	10,860,184.35	
ROCHE HOLDING AG-BR	1,921	419.600	806,051.60	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	40,075	389.300	15,601,197.50	
VIFOR PHARMA AG	2,638	169.150	446,217.70	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	145,488	7.154	1,040,821.15	
JULIUS BAER GROUP LTD	12,550	51.240	643,062.00	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,203	1,131.500	1,361,194.50	
UBS GROUP AG-REG	204,228	16.810	3,433,072.68	
BALOISE HOLDING AG - REG	2,475	173.500	429,412.50	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,834	616.600	1,130,844.40	
SWISS RE AG	16,690	88.360	1,474,728.40	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	8,712	455.300	3,966,573.60	
SWISS PRIME SITE-REG	3,906	94.950	370,874.70	
TEMENOS AG - REG	3,743	86.900	325,266.70	

	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	10,426	66.600	694,371.60	
	SWISSCOM AG-REG	1,399	567.400	793,792.60	
スイス・フラン小計		981,001		89,377,302.31 (12,024,822,253)	
デンマーク・クローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,509	542.400	2,988,081.60	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	11,512	465.700	5,361,138.40	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	513	2,002.000	1,027,026.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	60,424	202.400	12,229,817.60	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	168	17,230.000	2,894,640.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	311	17,645.000	5,487,595.00	
	DSV A/S	11,866	1,128.000	13,384,848.00	
	PANDORA A/S	5,888	628.400	3,700,019.20	
	CARLSBERG AS-B	5,585	833.200	4,653,422.00	
	AMBU A/S-B	8,356	105.250	879,469.00	
	COLOPLAST-B	6,399	1,073.000	6,866,127.00	
	DEMANT A/S	8,178	298.200	2,438,679.60	
	GN STORE NORD A/S	6,484	280.000	1,815,520.00	
	GENMAB A/S	3,688	2,528.000	9,323,264.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	96,328	794.000	76,484,432.00	
	DANSKE BANK A/S	39,103	114.500	4,477,293.50	
	TRYG A/S	16,989	167.750	2,849,904.75	
	ORSTED A/S	10,423	816.100	8,506,210.30	
デンマーク・クローネ小計		297,724		165,367,487.95 (3,019,610,330)	
ノルウェー・クローネ	AKER BP ASA	6,316	349.100	2,204,915.60	
	EQUINOR ASA	55,409	332.350	18,415,181.15	
	NORSK HYDRO ASA	83,294	87.100	7,254,907.40	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,005	486.300	4,379,131.50	
	MOWI ASA	23,318	248.800	5,801,518.40	
	ORKLA ASA	46,955	78.660	3,693,480.30	
	DNB BANK ASA	52,746	195.950	10,335,578.70	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,412	216.600	2,471,839.20	
	TELENOR ASA	40,694	130.850	5,324,809.90	
	ADEVINTA ASA	15,540	82.150	1,276,611.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	5,480	189.700	1,039,556.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	3,338	210.600	702,982.80	
ノルウェー・クローネ小計		353,507		62,900,511.95 (900,106,326)	
スウェーデン・クローナ	LUNDIN ENERGY AB	13,316	423.900	5,644,652.40	
	BOLIDEN AB	15,297	490.400	7,501,648.80	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	34,370	193.100	6,636,847.00	

ALFA LAVAL AB	18,697	312.000	5,833,464.00	
ASSA ABLOY AB-B	60,292	248.100	14,958,445.20	
ATLAS COPCO AB-A SHS	37,342	467.200	17,446,182.40	
ATLAS COPCO AB-B SHS	22,320	409.000	9,128,880.00	
EPIROC AB-A	34,230	194.300	6,650,889.00	
EPIROC AB-B	19,836	163.100	3,235,251.60	
HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	91.780	1,706,465.54	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,223	291.300	2,395,359.90	
LIFCO AB-B SHS	15,149	220.400	3,338,839.60	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	89,271	103.450	9,235,084.95	
SANDVIK AB	61,070	191.400	11,688,798.00	
SKANSKA AB-B SHS	17,183	205.000	3,522,515.00	
SKF AB-B SHARES	20,607	152.950	3,151,840.65	
VOLVO AB-A SHS	13,283	160.100	2,126,608.30	
VOLVO AB-B SHS	80,338	155.700	12,508,626.60	
SECURITAS AB-B SHS	16,123	112.400	1,812,225.20	
ELECTROLUX AB-B	11,555	148.960	1,721,232.80	
EVOLUTION AB	10,669	991.100	10,574,045.90	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	40,148	131.360	5,273,841.28	
SWEDISH MATCH AB	84,640	77.240	6,537,593.60	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	36,076	227.700	8,214,505.20	
GETINGE AB-B SHS	13,151	361.900	4,759,346.90	
NORDEA BANK ABP	184,357	97.760	18,022,740.32	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	100,891	107.850	10,881,094.35	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	77,668	93.540	7,265,064.72	
SWEDBANK AB - A SHARES	57,603	156.950	9,040,790.85	
EQT AB	15,443	361.000	5,574,923.00	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	7,211	262.300	1,891,445.30	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,642	257.300	2,738,186.60	
INVESTOR AB-A SHS	27,415	222.200	6,091,613.00	
INVESTOR AB-B SHS	101,275	206.400	20,903,160.00	
KINNEVIK AB - B	12,465	236.400	2,946,726.00	
LUNDBERGS AB-B SHS	3,368	486.000	1,636,848.00	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	5,323	579.200	3,083,081.60	
SAGAX AB-B	9,651	265.000	2,557,515.00	
SINCH AB	27,690	61.750	1,709,857.50	
ERICSSON LM-B SHS	159,685	89.420	14,279,032.70	
HEXAGON AB-B SHS	117,010	132.700	15,527,227.00	
TELE2 AB-B SHS	25,537	148.800	3,799,905.60	
TELIA CO AB	143,404	39.240	5,627,172.96	

	EMBRACER GROUP AB	30,012	81.750	2,453,481.00	
	スウェーデン・クローナ 小計	1,908,429		301,633,055.32 (3,972,507,339)	
ユーロ	ENI SPA	146,752	13.866	2,034,863.23	
	GALP ENERGIA SGPS SA	25,920	11.975	310,392.00	
	NESTE OYJ	23,055	44.360	1,022,719.80	
	OMV AG	8,389	43.890	368,193.21	
	REPSOL SA	79,358	13.235	1,050,303.13	
	TENARIS SA	25,963	14.855	385,680.36	
	TOTALENERGIES SE	142,236	46.425	6,603,306.30	
	AIR LIQUIDE SA	26,340	162.100	4,269,714.00	
	AKZO NOBEL N.V.	9,886	77.060	761,815.16	
	ARCELORMITTAL	37,054	29.280	1,084,941.12	
	ARKEMA	3,250	107.250	348,562.50	
	BASF SE	53,726	51.960	2,791,602.96	
	COVESTRO AG	11,797	43.620	514,585.14	
	CRH PLC	43,426	35.905	1,559,210.53	
	EVONIK INDUSTRIES AG	10,952	24.440	267,666.88	
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	3,370	30.380	102,380.60	
	HEIDELBERGCEMENT AG	8,677	50.920	441,832.84	
	KONINKLIJKE DSM NV	10,433	159.250	1,661,455.25	
	LANXESS AG	4,409	36.190	159,561.71	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	12,921	37.040	478,593.84	
	SOLVAY SA	4,802	88.300	424,016.60	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	30,234	18.805	568,550.37	
	SYMRISE AG	6,785	110.350	748,724.75	
	UMICORE	10,288	38.220	393,207.36	
	UPM-KYMMENE OYJ	33,126	31.000	1,026,906.00	
	VOESTALPINE AG	7,382	24.960	184,254.72	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	13,189	24.580	324,185.62	
	AIRBUS SE	34,199	104.660	3,579,267.34	
	ALSTOM	17,665	20.720	366,018.80	
	BOUYGUES SA	11,049	31.020	342,739.98	
	BRENNTAG SE	9,920	71.840	712,652.80	
	CNH INDUSTRIAL NV	54,775	14.225	779,174.37	
	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	29,471	52.080	1,534,849.68	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	23,340	23.750	554,325.00	
	DASSAULT AVIATION SA	1,720	156.000	268,320.00	
	EIFFAGE	4,989	91.800	457,990.20	
	FERROVIAL SA	24,693	25.200	622,263.60	
	GEA GROUP AG	8,178	36.720	300,296.16	
	IMCD NV	3,214	148.750	478,082.50	

KINGSPAN GROUP PLC	8,978	84.980	762,950.44	
KION GROUP AG	3,179	54.340	172,746.86	
KNORR-BREMSE AG	3,881	68.300	265,072.30	
KONE OYJ-B	20,623	46.620	961,444.26	
LEGRAND SA	15,079	81.760	1,232,859.04	
MTU AERO ENGINES AG	2,957	188.550	557,542.35	
PRYSMIAN SPA	17,186	30.870	530,531.82	
RATIONAL AG	350	612.500	214,375.00	
SAFRAN SA	20,172	101.540	2,048,264.88	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	31,211	141.860	4,427,592.46	
SIEMENS AG-REG	44,055	116.640	5,138,575.20	
SIEMENS ENERGY AG	19,855	19.375	384,690.62	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	11,482	15.465	177,569.13	
THALES SA	5,403	125.050	675,645.15	
VINCI SA	29,309	90.910	2,664,481.19	
WARTSILA OYJ ABP	26,753	8.390	224,457.67	
BUREAU VERITAS SA	17,817	24.970	444,890.49	
RANDSTAD NV	6,241	50.820	317,167.62	
TELEPERFORMANCE	3,420	334.300	1,143,306.00	
WOLTERS KLUWER	14,578	98.120	1,430,393.36	
ADP	1,346	138.350	186,219.10	
AENA SME SA	4,377	148.500	649,984.50	
ATLANTIA SPA	26,501	21.720	575,601.72	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	33,148	6.897	228,621.75	
DEUTSCHE POST AG-REG	54,453	40.425	2,201,262.52	
GETLINK SE	22,311	16.670	371,924.37	
INPOST SA	10,902	5.342	58,238.48	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	17,873	76.090	1,359,956.57	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	2,564	68.400	175,377.60	
CONTINENTAL AG	5,578	64.520	359,892.56	
FAURECIA	6,090	22.700	138,243.00	
FERRARI NV	6,949	206.600	1,435,663.40	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	49,868	62.500	3,116,750.00	
MICHELIN (CGDE)	9,617	117.900	1,133,844.30	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	7,765	81.120	629,896.80	
RENAULT SA	8,830	22.170	195,761.10	
STELLANTIS NV	118,658	13.906	1,650,058.14	
VALEO	14,444	16.535	238,831.54	
VOLKSWAGEN AG	1,960	210.800	413,168.00	
VOLKSWAGEN AG-PREF	10,563	151.100	1,596,069.30	
ADIDAS AG	11,195	202.400	2,265,868.00	

ESSILORLUXOTTICA	16,375	161.350	2,642,106.25	
HERMES INTERNATIONAL	1,777	1,263.000	2,244,351.00	
KERING	4,123	531.800	2,192,611.40	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	15,873	630.900	10,014,275.70	
MONCLER SPA	12,209	49.480	604,101.32	
PUMA SE	6,459	73.760	476,415.84	
SEB SA	1,127	124.100	139,860.70	
ACCOR SA	10,451	27.580	288,238.58	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	8,869	100.900	894,882.10	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,785	34.990	202,417.15	
SODEXO SA	4,760	69.260	329,677.60	
DELIVERY HERO SE	8,530	38.560	328,916.80	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	58,328	20.100	1,172,392.80	
JUST EAT TAKEAWAY	9,307	30.055	279,721.88	
PROSUS NV	54,174	48.005	2,600,622.87	
ZALANDO SE	12,367	44.560	551,073.52	
CARREFOUR SA	35,990	20.080	722,679.20	
COLRUYT SA	2,164	39.550	85,586.20	
HELLOFRESH SE	9,790	38.210	374,075.90	
JERONIMO MARTINS	12,978	21.480	278,767.44	
KESKO OYJ-B SHS	13,402	23.690	317,493.38	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	55,657	29.735	1,654,960.89	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	49,732	53.970	2,684,036.04	
DANONE	37,154	51.930	1,929,407.22	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	28,021	10.635	298,003.33	
HEINEKEN HOLDING NV	6,168	71.250	439,470.00	
HEINEKEN NV	14,659	88.600	1,298,787.40	
JDE PEET'S NV	6,660	26.820	178,621.20	
KERRY GROUP PLC-A	8,193	102.050	836,095.65	
PERNOD RICARD SA	11,879	197.150	2,341,944.85	
REMY COINTREAU	1,273	191.100	243,270.30	
BEIERSDORF AG	5,138	94.000	482,972.00	
HENKEL AG & CO KGAA	5,974	58.700	350,673.80	
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	11,499	59.460	683,730.54	
L'OREAL	14,230	361.650	5,146,279.50	
AMPLIFON SPA	7,567	40.210	304,269.07	
BIOMERIEUX	2,791	93.200	260,121.20	

CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,161	131.450	284,063.45	
DIASORIN SPA	1,313	134.800	176,992.40	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	11,118	62.200	691,539.60	
FRESENIUS SE & CO KGAA	26,317	33.920	892,672.64	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	52,727	27.260	1,437,338.02	
ORPEA	2,695	37.200	100,254.00	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,308	383.500	501,618.00	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	16,426	55.000	903,430.00	
ARGENX SE	2,644	300.000	793,200.00	
BAYER AG-REG	55,293	67.420	3,727,854.06	
EUROFINS SCIENTIFIC	7,010	96.180	674,221.80	
GRIFOLS SA	15,169	15.400	233,602.60	
IPSEN	1,498	115.000	172,270.00	
MERCK KGAA	7,777	184.200	1,432,523.40	
ORION OYJ-CLASS B	6,261	42.230	264,402.03	
QIAGEN N.V.	12,543	43.800	549,383.40	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	4,578	47.680	218,279.04	
SANOFI	65,399	103.220	6,750,484.78	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,555	354.600	551,403.00	
UCB SA	6,623	113.850	754,028.55	
ABN AMRO BANK NV-CVA	28,787	11.715	337,239.70	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	378,832	4.970	1,882,795.04	
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	187,906	0.010	1,879.06	
BANCO SANTANDER SA	983,269	3.133	3,080,581.77	
BNP PARIBAS	65,416	48.710	3,186,413.36	
CAIXABANK SA	277,723	3.117	865,662.59	
COMMERZBANK AG	46,644	6.418	299,361.19	
CREDIT AGRICOLE SA	73,102	9.917	724,952.53	
ERSTE GROUP BANK AG	19,383	31.050	601,842.15	
FINECOBANK SPA	32,034	13.955	447,034.47	
ING GROEP NV	230,297	9.340	2,150,973.98	
INTESA SANPAOLO	977,250	1.941	1,896,842.25	
KBC GROUP NV	13,092	62.740	821,392.08	
MEDIOBANCA SPA	31,303	8.934	279,661.00	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	7,066	11.480	81,117.68	
SOCIETE GENERALE SA	41,025	22.525	924,088.12	
UNICREDIT SPA	112,845	9.339	1,053,859.45	
AMUNDI SA	3,955	59.450	235,124.75	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	113,478	10.808	1,226,470.22	

DEUTSCHE BOERSE AG	10,701	166.450	1,781,181.45	
EURAZEO SE	1,792	75.750	135,744.00	
EURONEXT NV	5,502	82.200	452,264.40	
EXOR NV	6,204	67.660	419,762.64	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,914	92.500	547,045.00	
SOFINA	804	318.000	255,672.00	
WENDEL	1,082	90.900	98,353.80	
AEGON NV	91,609	5.092	466,473.02	
AGEAS	11,247	45.880	516,012.36	
ALLIANZ SE-REG	23,552	219.200	5,162,598.40	
ASSICURAZIONI GENERALI	64,729	19.275	1,247,651.47	
AXA SA	113,586	26.775	3,041,265.15	
CNP ASSURANCES	8,978	21.860	196,259.08	
HANNOVER RUECK SE	3,598	149.900	539,340.20	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	8,295	242.800	2,014,026.00	
NN GROUP NV	14,069	47.700	671,091.30	
POSTE ITALIANE SPA	26,562	9.834	261,210.70	
SAMPO OYJ-A SHS	28,454	46.630	1,326,810.02	
AROUNDTOWN SA	52,560	4.976	261,538.56	
LEG IMMOBILIEN SE	3,680	103.300	380,144.00	
VONOVIA SE	43,654	39.970	1,744,850.38	
ADYEN NV	1,069	1,688.800	1,805,327.20	
AMADEUS IT GROUP SA	24,570	55.960	1,374,937.20	
BECHTLE AG	4,305	44.970	193,595.85	
CAPGEMINI SE	8,961	189.950	1,702,141.95	
DASSAULT SYSTEMES SE	39,595	40.820	1,616,267.90	
EDENRED	16,042	48.680	780,924.56	
NEMETSCHEK SE	3,011	82.000	246,902.00	
NEXI SPA	30,853	9.336	288,043.60	
SAP SE	60,055	98.320	5,904,607.60	
WORLDLINE SA	12,774	35.260	450,411.24	
NOKIA OYJ	296,676	4.867	1,443,922.09	
ASM INTERNATIONAL NV	2,455	297.950	731,467.25	
ASML HOLDING NV	23,576	560.400	13,211,990.40	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	71,533	26.895	1,923,880.03	
STMICROELECTRONICS NV	37,804	34.750	1,313,689.00	
CELLNEX TELECOM SA	29,081	44.060	1,281,308.86	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	188,344	17.056	3,212,395.26	
ELISA OYJ	8,681	55.640	483,010.84	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,804	10.385	164,124.54	
KONINKLIJKE KPN NV	173,603	3.359	583,132.47	

	ORANGE	116,269	11.106	1,291,283.51	
	PROXIMUS	10,895	17.245	187,884.27	
	TELECOM ITALIA SPA	696,355	0.307	213,780.98	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	46,895	2.714	127,273.03	
	TELEFONICA SA	316,236	4.822	1,524,889.99	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,269	31.390	165,393.91	
	E.ON SE	126,998	10.195	1,294,744.61	
	EDF	32,658	8.332	272,106.45	
	EDP RENOVAVEIS SA	14,791	22.900	338,713.90	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	170,355	4.665	794,706.07	
	ELIA GROUP SA/NV	2,106	153.000	322,218.00	
	ENAGAS SA	14,471	20.660	298,970.86	
	ENDESA SA	14,104	19.425	273,970.20	
	ENEL SPA	475,178	6.248	2,968,912.14	
	ENGIE	110,679	11.448	1,267,053.19	
	FORTUM OYJ	24,312	15.565	378,416.28	
	IBERDROLA SA	337,074	10.480	3,532,535.52	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	12,930	29.330	379,236.90	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	23,632	19.240	454,679.68	
	RWE AG	34,673	40.480	1,403,563.04	
	SNAM SPA	106,707	5.344	570,242.20	
	TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA	75,662	8.070	610,592.34	
	UNIPER SE	4,697	23.220	109,064.34	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	36,122	27.600	996,967.20	
	VERBUND AG	3,190	95.300	304,007.00	
	BOLLORE SE	39,433	4.512	177,921.69	
	PUBLICIS GROUPE	13,301	54.240	721,446.24	
	SCOUT24 SE	4,671	60.820	284,090.22	
	UBISOFT ENTERTAINMENT	4,745	39.320	186,573.40	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	44,422	23.995	1,065,905.89	
	VIVENDI SE	38,496	11.840	455,792.64	
ユーロ小計		10,772,399		252,923,067.24 (34,359,598,685)	
合　計		61,243,682		372,473,853,310 (372,473,853,310)	

（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	605銘柄	70.3%	73.3%

カナダ・ドル	株式	86銘柄	3.8%	4.0%
オーストラリア・ドル	株式	50銘柄	2.2%	2.3%
香港・ドル	株式	28銘柄	0.7%	0.8%
シンガポール・ドル	株式	14銘柄	0.3%	0.3%
ニュージーランド・ドル	株式	6銘柄	0.1%	0.1%
イギリス・ポンド	株式	79銘柄	4.4%	4.6%
イスラエル・シュケル	株式	8銘柄	0.1%	0.1%
スイス・フラン	株式	41銘柄	3.1%	3.2%
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	1.0%	1.1%
ユーロ	株式	228銘柄	8.8%	9.2%

(b)株式以外の有価証券

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	25,432.00	318,662.96	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8,490.00	1,676,265.60	
		AMERICAN TOWER CORP	26,197.00	6,737,344.46	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	90,010.00	608,467.60	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	8,302.00	2,046,276.96	
		BOSTON PROPERTIES INC	7,835.00	967,152.40	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,009.00	992,806.98	
		CROWN CASTLE INTL CORP	25,016.00	4,855,355.44	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	16,754.00	2,438,042.08	
		DUKE REALTY CORP	21,667.00	1,275,969.63	
		EQUINIX INC	5,232.00	3,880,312.80	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,664.00	680,643.84	
		EQUITY RESIDENTIAL	21,246.00	1,917,663.96	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,691.00	1,280,001.89	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	7,376.00	1,569,981.60	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	28,756.00	1,008,760.48	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	37,569.00	684,507.18	
		INVITATION HOMES INC	32,632.00	1,351,617.44	
		IRON MOUNTAIN INC	15,785.00	883,170.75	
		KIMCO REALTY CORP	35,169.00	858,475.29	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	31,858.00	647,673.14	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	6,678.00	1,386,820.26	
		PROLOGIS INC	42,504.00	7,027,186.32	

	PUBLIC STORAGE	8,778.00	3,570,627.06	
	REALTY INCOME CORP	31,385.00	2,245,910.60	
	REGENCY CENTERS CORP	8,289.00	575,919.72	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	5,916.00	2,097,103.68	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	18,517.00	2,336,475.06	
	SUN COMMUNITIES INC	6,088.00	1,113,190.80	
	UDR INC	16,633.00	959,058.78	
	VENTAS INC	23,363.00	1,424,909.37	
	VICI PROPERTIES INC	36,025.00	1,018,066.50	
	VORNADO REALTY TRUST	8,706.00	362,953.14	
	WELLTOWER INC	24,682.00	2,383,293.92	
	WEYERHAEUSER CO	44,952.00	1,779,200.16	
	WP CAREY INC	11,067.00	908,379.36	
	アメリカ・ドル小計	757,273.00	65,868,247.21 (8,274,369,216)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,971.00	204,943.31	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,441.00	182,825.37	
	カナダ・ドル小計	11,412.00	387,768.68 (38,532,574)	
オーストラリア・ドル	APA GROUP	68,281.00	737,434.80	
	DEXUS/AU	72,475.00	782,730.00	
	GOODMAN GROUP	95,350.00	2,181,608.00	
	GPT GROUP	121,221.00	619,439.31	
	LENDLEASE GROUP	36,263.00	400,706.15	
	MIRVAC GROUP	200,053.00	486,128.79	
	SCENTRE GROUP	275,200.00	811,840.00	
	STOCKLAND	127,393.00	532,502.74	
	TRANSURBAN GROUP	176,197.00	2,408,612.99	
	VICINITY CENTRES	241,241.00	441,471.03	
	オーストラリア・ドル小計	1,413,674.00	9,402,473.81 (879,695,450)	
香港・ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS - SS	193,500.00	1,489,950.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	197,000.00	2,135,480.00	
	LINK REIT	110,100.00	7,426,245.00	
	香港・ドル小計	500,600.00	11,051,675.00 (177,158,350)	
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	170,500.00	491,040.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	259,616.00	586,732.16	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	112,400.00	210,188.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	208,100.00	380,823.00	

		シンガポール・ドル小計	750,616.00	1,668,783.16 (153,661,553)	
	イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	62,406.00	319,643.53	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	39,861.00	298,957.50	
		SEGRO PLC	68,623.00	920,920.66	
		イギリス・ポンド小計	170,890.00	1,539,521.69 (251,280,730)	
	ユーロ	COVIVIO	2,388.00	175,637.40	
		GECINA SA	2,189.00	241,665.60	
		KLEPIERRE	13,600.00	308,992.00	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	7,024.00	489,783.52	
		ユーロ小計	25,201.00	1,216,078.52 (165,204,267)	
投資証券合計				9,939,902,140 (9,939,902,140)	
合　計				9,939,902,140 (9,939,902,140)	

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

通　貨	銘柄数		組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券	36銘柄	2.1%	83.2%
カナダ・ドル	投資証券	2銘柄	0.0%	0.4%
オーストラリア・ドル	投資証券	10銘柄	0.2%	8.9%
香港・ドル	投資証券	3銘柄	0.0%	1.8%
シンガポール・ドル	投資証券	4銘柄	0.0%	1.5%
イギリス・ポンド	投資証券	3銘柄	0.1%	2.5%
ユーロ	投資証券	4銘柄	0.0%	1.7%

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「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4月13日現在）	（2022年4月13日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	45,981,282	-
金銭信託	228,213,133	14,004,575
コール・ローン	118,273,326	537,206,904
国債証券	162,158,985,055	155,013,648,989
未収入金	-	87,233,725
未収利息	1,125,045,179	1,052,104,210

前払費用	21,150,614	55,878,885
流動資産合計	163,697,648,589	156,760,077,288
資産合計	163,697,648,589	156,760,077,288
負債の部		
流動負債		
未払解約金	9,011,993	202,299,339
未払利息	324	-
その他未払費用	3,950	1,344
流動負債合計	9,016,267	202,300,683
負債合計	9,016,267	202,300,683
純資産の部		
元本等		
元本	84,438,755,498	78,998,924,437
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	79,249,876,824	77,558,852,168
元本等合計	163,688,632,322	156,557,776,605
純資産合計	163,688,632,322	156,557,776,605
負債純資産合計	163,697,648,589	156,760,077,288

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2021年4月14日 至 2022年4月13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。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
２．デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
３．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4月13日現在）	（2022年4月13日現在）
１．当計算期間の末日における受益権の総数	84,438,755,498口	78,998,924,437口
２．１単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　1.9385円 （１万口当たりの純資産額19,385円）	1口当たり純資産額　1.9818円 （１万口当たりの純資産額19,818円）

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	自 2021年4月14日 至 2022年4月13日
１．金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
２．金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	（2022年4月13日現在）
１．貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 2021年4月14日 至 2022年4月13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4月13日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	84,556,952,355円
同期中における追加設定元本額	11,304,078,309円
同期中における一部解約元本額	11,422,275,166円
2021年4月13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	23,568,244,950円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	727,323,151円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	2,025,052,215円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	1,054,240,718円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	147,217,912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）	6,940,706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）	31,877,472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）	102,070,891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）	178,438,989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）	114,686,398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）	213,016,075円
三井住友・ＤＣ年金バランスゼロ（債券型）	24,554,885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）	124,954,775円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	43,978,309円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	12,865,502円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	68,983,578円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	45,540,068円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	104,193,059円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	33,020,764円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	21,739,889円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	79,084,232円
三井住友ＤＳ・外国債券インデックス年金ファンド	124,065,397円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	9,459,055円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	23,768,100円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	15,321,018円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	1,832,778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＞	2,341,294,117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＞	8,328,869,926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＞	11,174,840,543円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	35,901,694円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	97,373,210円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	737,710,826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＞	1,100,173,191円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	1,455,394,432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＞	5,272,263,603円
ＳＭＡＭ・バランスＶＡ株４０Ｔ＜適格機関投資家限定＞	619,895円
ＳＭＡＭ・外国債券パッシブファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	8,795,241,360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）	345,889,060円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	154,703,653円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	90,561,097円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	35,408,120円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	11,874,819円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	110,155,429円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	454,726,492円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	120,646,991円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	42,530,817円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	5,288,637円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	1,117,480,487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＞	793,807,908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＞	1,093,960,390円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	3,262,823,790円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	474,627,289円
ＳＭＡＭ・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーションⅡ・ファンド＜適格機関投資家限定＞	52,198,733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＞	64,301,287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＞	177,723,755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＞	149,075,586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Ⅱ＜適格機関投資家限定＞	837,661,929円
合　計	84,438,755,498円

（2022年4月13日現在）

開示対象ファンドの 期首における当該親投資信託の元本額	84,438,755,498円
同期中における追加設定元本額	11,076,997,643円
同期中における一部解約元本額	16,516,828,704円

2022年4月13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	24,393,880,841円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	797,136,312円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	2,119,967,555円

三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	1,147,542,270円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	158,413,037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）	6,893,764円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２５（４資産タイプ）	29,273,421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）	94,401,071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）	225,146,317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）	156,890,144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）	262,638,809円
三井住友・ＤＣ年金バランスゼロ（債券型）	23,814,887円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	53,018,449円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	75,940,895円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	53,017,014円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	17,667,980円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	72,121,077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）	133,397,804円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	38,493,469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ＮＩＳＡ・世界分散ファンド	136,355,816円
三井住友ＤＳ・外国債券インデックス年金ファンド	294,281,824円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	14,238,080円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	42,018,400円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	30,944,093円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	2,203,842円
日興ＦＷＳ・先進国債インデックス（為替ヘッジなし）	223,960,014円
三井住友ＤＳ・先進国債インデックス・ファンド	4,196,884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＞	3,864,757,153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＞	40,032,740円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	6,840,867,224円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	4,426,406,787円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	10,181,017,794円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	34,375,893円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	87,983,369円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	690,283,030円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ国際分散型＜適格機関投資家限定＞	117,223,907円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	1,014,133,750円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	1,391,887,471円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	1,524,271,237円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	4,687,829,375円
ＳＭＡＭ・バランスＶＡ株４０Ｔ＜適格機関投資家限定＞	627,347円
ＳＭＡＭ・外国債券パッシブファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	7,892,173,791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）	320,769,429円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	143,270,463円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	78,444,198円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	33,971,193円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	11,926,289円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	95,205,741円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	404,375,583円

ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	99,457,001円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	40,181,590円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	5,252,180円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	1,001,905,605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＞	619,332,518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＞	865,687,557円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	779,208,964円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	341,578,053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＞	190,502,250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＞	124,850,498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＞	159,858,275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Ⅱ＜適格機関投資家限定＞	211,033,507円
合　計	78,998,924,437円

（３）附属明細表

①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	7,392,539.00	
		T 0.125 07/15/23	4,300,000.00	4,198,520.00	
		T 0.125 08/15/23	8,000,000.00	7,790,560.00	
		T 0.125 10/15/23	5,700,000.00	5,523,186.00	
		T 0.25 04/15/23	5,000,000.00	4,921,650.00	
		T 0.25 06/15/23	7,700,000.00	7,548,387.00	
		T 0.25 06/30/25	2,400,000.00	2,222,424.00	
		T 0.25 07/31/25	3,300,000.00	3,048,375.00	
		T 0.25 09/30/25	2,000,000.00	1,841,000.00	
		T 0.25 11/15/23	3,000,000.00	2,906,460.00	
		T 0.375 04/30/25	200,000.00	186,858.00	
		T 0.375 07/31/27	4,700,000.00	4,162,414.00	
		T 0.375 09/15/24	3,000,000.00	2,849,040.00	
		T 0.375 09/30/27	4,800,000.00	4,230,720.00	
		T 0.375 11/30/25	2,000,000.00	1,841,480.00	
		T 0.375 12/31/25	3,000,000.00	2,757,750.00	
		T 0.5 03/31/25	600,000.00	563,526.00	
		T 0.5 04/30/27	200,000.00	179,592.00	
		T 0.5 05/31/27	3,000,000.00	2,684,640.00	
		T 0.5 06/30/27	4,400,000.00	3,929,200.00	
		T 0.625 03/31/27	600,000.00	543,492.00	
		T 0.625 05/15/30	7,500,000.00	6,362,100.00	

		T 0.625 07/31/26	3,600,000.00	3,299,184.00	
		T 0.625 08/15/30	8,800,000.00	7,415,320.00	
		T 0.625 10/15/24	4,400,000.00	4,197,160.00	
		T 0.625 11/30/27	2,100,000.00	1,869,231.00	
		T 0.625 12/31/27	7,200,000.00	6,398,712.00	
		T 0.75 01/31/28	6,700,000.00	5,990,470.00	
		T 0.75 11/15/24	5,200,000.00	4,967,612.00	
		T 0.875 11/15/30	7,000,000.00	6,013,420.00	
		T 1 07/31/28	5,900,000.00	5,306,755.00	
		T 1 12/15/24	4,500,000.00	4,320,315.00	
		T 1.125 02/15/31	8,500,000.00	7,432,145.00	
		T 1.125 02/28/25	1,500,000.00	1,437,420.00	
		T 1.125 02/28/27	2,000,000.00	1,858,660.00	
		T 1.125 05/15/40	2,000,000.00	1,476,860.00	
		T 1.125 08/15/40	700,000.00	514,115.00	
		T 1.125 08/31/28	3,500,000.00	3,167,885.00	
		T 1.25 05/15/50	5,100,000.00	3,508,239.00	
		T 1.25 06/30/28	3,000,000.00	2,743,920.00	
		T 1.25 07/31/23	3,000,000.00	2,969,760.00	
		T 1.25 08/15/31	5,500,000.00	4,833,125.00	
		T 1.25 09/30/28	4,500,000.00	4,104,450.00	
		T 1.25 11/30/26	4,200,000.00	3,939,432.00	
		T 1.25 12/31/26	2,300,000.00	2,154,272.00	
		T 1.375 01/31/25	1,900,000.00	1,836,312.00	
		T 1.375 06/30/23	500,000.00	496,425.00	
		T 1.375 08/15/50	4,500,000.00	3,196,395.00	
		T 1.375 08/31/23	2,500,000.00	2,475,000.00	
		T 1.375 08/31/26	7,100,000.00	6,716,103.00	
		T 1.375 09/30/23	3,000,000.00	2,966,340.00	
		T 1.375 10/31/28	6,000,000.00	5,504,280.00	
		T 1.375 11/15/31	5,400,000.00	4,786,560.00	
		T 1.375 11/15/40	2,000,000.00	1,534,060.00	
		T 1.375 12/31/28	2,500,000.00	2,291,100.00	
		T 1.5 01/31/27	2,400,000.00	2,272,680.00	
		T 1.5 02/15/30	4,500,000.00	4,112,190.00	
		T 1.5 03/31/23	3,000,000.00	2,992,590.00	
		T 1.5 10/31/24	5,500,000.00	5,351,720.00	
		T 1.5 11/30/24	800,000.00	777,872.00	
		T 1.5 11/30/28	2,300,000.00	2,125,683.00	
		T 1.625 02/15/26	2,900,000.00	2,788,176.00	
		T 1.625 04/30/23	3,000,000.00	2,992,590.00	
		T 1.625 05/15/26	14,950,000.00	14,338,545.00	
		T 1.625 05/15/31	4,300,000.00	3,921,385.00	
		T 1.625 05/31/23	3,000,000.00	2,991,090.00	

		T 1.625 08/15/29	2,450,000.00	2,273,796.00	
		T 1.625 09/30/26	3,900,000.00	3,728,127.00	
		T 1.625 10/31/23	3,000,000.00	2,973,270.00	
		T 1.625 11/15/50	3,200,000.00	2,425,472.00	
		T 1.625 11/30/26	200,000.00	190,858.00	
		T 1.75 01/31/29	4,300,000.00	4,036,754.00	
		T 1.75 03/15/25	1,500,000.00	1,464,375.00	
		T 1.75 05/15/23	2,700,000.00	2,694,384.00	
		T 1.75 06/30/24	6,200,000.00	6,101,420.00	
		T 1.75 07/31/24	850,000.00	835,983.50	
		T 1.75 08/15/41	3,500,000.00	2,845,360.00	
		T 1.75 11/15/29	4,000,000.00	3,734,680.00	
		T 1.75 12/31/26	3,500,000.00	3,353,000.00	
		T 1.875 02/15/32	4,200,000.00	3,893,526.00	
		T 1.875 02/15/51	5,800,000.00	4,679,846.00	
		T 1.875 02/28/27	1,200,000.00	1,156,404.00	
		T 1.875 02/28/29	2,800,000.00	2,649,584.00	
		T 1.875 08/31/24	3,800,000.00	3,742,392.00	
		T 1.875 11/15/51	1,300,000.00	1,051,063.00	
		T 2 02/15/25	3,500,000.00	3,440,115.00	
		T 2 02/15/50	2,800,000.00	2,333,604.00	
		T 2 04/30/24	2,000,000.00	1,982,800.00	
		T 2 05/31/24	3,300,000.00	3,268,287.00	
		T 2 06/30/24	4,100,000.00	4,057,073.00	
		T 2 08/15/25	4,300,000.00	4,206,905.00	
		T 2 08/15/51	4,700,000.00	3,911,998.00	
		T 2 11/15/26	5,000,000.00	4,849,800.00	
		T 2.125 02/29/24	2,000,000.00	1,991,160.00	
		T 2.125 03/31/24	6,500,000.00	6,464,900.00	
		T 2.125 05/15/25	1,900,000.00	1,870,303.00	
		T 2.125 07/31/24	3,500,000.00	3,468,255.00	
		T 2.125 09/30/24	4,000,000.00	3,957,160.00	
		T 2.125 11/30/23	3,100,000.00	3,093,335.00	
		T 2.125 11/30/24	2,600,000.00	2,566,460.00	
		T 2.25 01/31/24	2,200,000.00	2,196,128.00	
		T 2.25 02/15/27	4,400,000.00	4,312,660.00	
		T 2.25 02/15/52	700,000.00	619,003.00	
		T 2.25 03/31/26	13,300,000.00	13,094,249.00	
		T 2.25 04/30/24	3,800,000.00	3,785,864.00	
		T 2.25 05/15/41	3,000,000.00	2,663,430.00	
		T 2.25 08/15/27	4,200,000.00	4,108,776.00	
		T 2.25 08/15/46	2,450,000.00	2,133,411.00	
		T 2.25 08/15/49	3,500,000.00	3,086,265.00	
		T 2.25 10/31/24	800,000.00	793,560.00	

		T 2.25 11/15/24	5,100,000.00	5,059,353.00	
		T 2.25 11/15/25	4,000,000.00	3,942,000.00	
		T 2.25 11/15/27	4,400,000.00	4,294,092.00	
		T 2.25 12/31/23	3,000,000.00	2,998,110.00	
		T 2.25 12/31/24	3,900,000.00	3,864,042.00	
		T 2.375 02/15/42	3,600,000.00	3,260,808.00	
		T 2.375 02/29/24	3,700,000.00	3,700,703.00	
		T 2.375 05/15/27	1,000,000.00	985,420.00	
		T 2.375 05/15/29	400,000.00	390,796.00	
		T 2.375 05/15/51	1,400,000.00	1,269,184.00	
		T 2.375 08/15/24	5,600,000.00	5,580,288.00	
		T 2.375 11/15/49	1,900,000.00	1,723,490.00	
		T 2.5 01/31/25	3,400,000.00	3,388,032.00	
		T 2.5 02/15/45	4,100,000.00	3,734,198.00	
		T 2.5 02/15/46	2,900,000.00	2,650,078.00	
		T 2.5 02/28/26	8,500,000.00	8,438,885.00	
		T 2.5 05/15/24	5,700,000.00	5,706,213.00	
		T 2.5 05/15/46	3,600,000.00	3,289,500.00	
		T 2.5 08/15/23	5,000,000.00	5,028,500.00	
		T 2.625 01/31/26	2,700,000.00	2,695,653.00	
		T 2.625 02/15/29	1,800,000.00	1,787,400.00	
		T 2.625 03/31/25	1,000,000.00	999,920.00	
		T 2.625 12/31/23	1,900,000.00	1,909,937.00	
		T 2.625 12/31/25	4,400,000.00	4,393,268.00	
		T 2.75 02/15/24	5,100,000.00	5,135,241.00	
		T 2.75 02/15/28	4,800,000.00	4,806,336.00	
		T 2.75 02/28/25	2,000,000.00	2,006,080.00	
		T 2.75 04/30/23	2,900,000.00	2,927,057.00	
		T 2.75 05/31/23	1,000,000.00	1,009,060.00	
		T 2.75 06/30/25	4,600,000.00	4,618,308.00	
		T 2.75 07/31/23	2,000,000.00	2,017,340.00	
		T 2.75 08/15/42	2,000,000.00	1,912,960.00	
		T 2.75 08/15/47	3,600,000.00	3,469,500.00	
		T 2.75 08/31/23	3,800,000.00	3,827,892.00	
		T 2.75 08/31/25	2,100,000.00	2,105,565.00	
		T 2.75 11/15/23	4,200,000.00	4,232,466.00	
		T 2.75 11/15/42	300,000.00	286,569.00	
		T 2.75 11/15/47	1,500,000.00	1,446,675.00	
		T 2.875 04/30/25	2,200,000.00	2,216,148.00	
		T 2.875 05/15/28	9,000,000.00	9,064,260.00	
		T 2.875 05/15/43	2,400,000.00	2,333,040.00	
		T 2.875 05/15/49	1,400,000.00	1,399,776.00	
		T 2.875 05/31/25	1,100,000.00	1,107,898.00	
		T 2.875 08/15/28	4,500,000.00	4,532,670.00	

	T 2.875 08/15/45	3,300,000.00	3,217,731.00	
	T 2.875 10/31/23	1,000,000.00	1,009,600.00	
	T 2.875 11/15/46	300,000.00	294,513.00	
	T 2.875 11/30/23	2,000,000.00	2,019,200.00	
	T 2.875 11/30/25	2,500,000.00	2,517,850.00	
	T 3 02/15/47	2,500,000.00	2,510,725.00	
	T 3 02/15/48	2,400,000.00	2,432,040.00	
	T 3 02/15/49	3,300,000.00	3,373,194.00	
	T 3 05/15/42	800,000.00	797,496.00	
	T 3 05/15/45	3,000,000.00	2,985,000.00	
	T 3 05/15/47	1,800,000.00	1,810,404.00	
	T 3 08/15/48	900,000.00	913,005.00	
	T 3 09/30/25	4,000,000.00	4,047,160.00	
	T 3 10/31/25	3,100,000.00	3,136,797.00	
	T 3 11/15/44	3,500,000.00	3,475,640.00	
	T 3 11/15/45	2,700,000.00	2,694,087.00	
	T 3.125 02/15/42	1,000,000.00	1,017,100.00	
	T 3.125 02/15/43	2,300,000.00	2,326,588.00	
	T 3.125 05/15/48	2,400,000.00	2,494,296.00	
	T 3.125 08/15/44	3,300,000.00	3,343,560.00	
	T 3.125 11/15/28	2,900,000.00	2,965,018.00	
	T 3.375 05/15/44	3,000,000.00	3,158,670.00	
	T 3.375 11/15/48	3,100,000.00	3,379,000.00	
	T 3.5 02/15/39	200,000.00	216,796.00	
	T 3.625 02/15/44	3,600,000.00	3,934,944.00	
	T 3.625 08/15/43	2,400,000.00	2,619,360.00	
	T 3.75 08/15/41	1,500,000.00	1,665,225.00	
	T 3.75 11/15/43	700,000.00	778,750.00	
	T 3.875 08/15/40	500,000.00	565,310.00	
	T 4.25 05/15/39	100,000.00	118,656.00	
	T 4.25 11/15/40	600,000.00	709,734.00	
	T 4.375 05/15/40	900,000.00	1,085,202.00	
	T 4.375 05/15/41	300,000.00	360,750.00	
	T 4.375 11/15/39	700,000.00	841,750.00	
	T 4.5 08/15/39	300,000.00	366,654.00	
	T 4.625 02/15/40	1,100,000.00	1,366,310.00	
	T 4.75 02/15/41	900,000.00	1,134,207.00	
	T 5.25 11/15/28	500,000.00	576,050.00	
	T 5.375 02/15/31	320,000.00	386,998.40	
	T 6 02/15/26	1,000,000.00	1,123,120.00	
	T 6.25 08/15/23	800,000.00	845,056.00	
	T-BOND 15/11/2027	1,000,000.00	1,176,250.00	
	アメリカ・ドル小計	632,420,000.00	603,489,773.90 (75,810,385,397)	

カナダ・ドル	CAN 0.5 09/01/25	2,700,000.00	2,528,415.00	
	CAN 1 06/01/27	600,000.00	556,488.00	
	CAN 1.25 06/01/30	6,200,000.00	5,588,122.00	
	CAN 1.5 06/01/23	1,200,000.00	1,192,164.00	
	CAN 1.5 06/01/26	3,200,000.00	3,078,400.00	
	CAN 1.5 09/01/24	2,000,000.00	1,960,220.00	
	CAN 1.5 12/01/31	400,000.00	361,588.00	
	CAN 1.75 12/01/53	500,000.00	407,280.00	
	CAN 2 06/01/28	700,000.00	679,392.00	
	CAN 2 09/01/23	1,200,000.00	1,197,252.00	
	CAN 2.25 03/01/24	1,000,000.00	998,510.00	
	CAN 2.25 06/01/25	1,000,000.00	994,420.00	
	CAN 2.25 06/01/29	1,900,000.00	1,861,696.00	
	CAN 2.5 06/01/24	2,100,000.00	2,106,090.00	
	CAN 2.75 12/01/48	1,300,000.00	1,331,759.00	
	CAN 3.5 12/01/45	1,200,000.00	1,377,612.00	
	CAN 4 06/01/41	1,800,000.00	2,151,630.00	
	CAN 5 06/01/37	1,450,000.00	1,863,076.00	
	CAN 5.75 06/01/29	250,000.00	301,562.50	
	CAN 5.75 06/01/33	400,000.00	517,364.00	
	CANADA 2.75 12/01/64	700,000.00	714,875.00	
	カナダ・ドル小計	31,800,000.00	31,767,915.50 (3,156,777,763)	
オーストラリア・ドル	ACGB 0.25 11/21/25	800,000.00	733,576.00	
	ACGB 1.5 06/21/31	2,800,000.00	2,452,716.00	
	ACGB 1.75 06/21/51	500,000.00	345,660.00	
	ACGB 2.25 05/21/28	2,400,000.00	2,312,976.00	
	ACGB 2.5 05/21/30	2,250,000.00	2,167,245.00	
	ACGB 2.75 04/21/24	2,500,000.00	2,528,200.00	
	ACGB 2.75 06/21/35	800,000.00	762,152.00	
	ACGB 2.75 11/21/27	900,000.00	894,834.00	
	ACGB 2.75 11/21/28	200,000.00	197,854.00	
	ACGB 2.75 11/21/29	2,600,000.00	2,558,426.00	
	ACGB 3 03/21/47	1,200,000.00	1,112,784.00	
	ACGB 3.25 04/21/25	1,300,000.00	1,326,078.00	
	ACGB 3.25 04/21/29	800,000.00	814,880.00	
	ACGB 3.25 06/21/39	2,550,000.00	2,526,234.00	
	ACGB 3.75 04/21/37	1,200,000.00	1,272,180.00	
	ACGB 4.25 04/21/26	2,650,000.00	2,804,124.00	
	ACGB 4.5 04/21/33	1,100,000.00	1,243,770.00	
	ACGB 5.5 04/21/23	900,000.00	937,674.00	
	オーストラリア・ドル小計	27,450,000.00	26,991,363.00 (2,525,311,922)	
シンガ	SIGB 1.25 11/01/26	100,000.00	95,070.00	

	ポール・ドル	SIGB 1.625 07/01/31	200,000.00	183,636.00	
		SIGB 2.25 08/01/36	1,200,000.00	1,128,732.00	
		SIGB 2.625 05/01/28	800,000.00	802,800.00	
		SIGB 2.75 03/01/46	700,000.00	693,000.00	
		SIGB 2.75 04/01/42	400,000.00	399,848.00	
		SIGB 2.75 07/01/23	1,200,000.00	1,216,320.00	
		SIGB 2.875 09/01/30	200,000.00	203,400.00	
		SIGB 3 09/01/24	100,000.00	102,290.00	
		SIGB 3.375 09/01/33	750,000.00	796,125.00	
		SIGB 3.5 03/01/27	1,500,000.00	1,568,175.00	
	シンガポール・ドル小計		7,150,000.00	7,189,396.00 (661,999,584)	
	イギリス・ポンド	UK TSY GILT	400,000.00	349,776.00	
		UKT 0.125 01/30/26	1,500,000.00	1,422,990.00	
		UKT 0.25 01/31/25	300,000.00	288,945.00	
		UKT 0.25 07/31/31	1,600,000.00	1,391,200.00	
		UKT 0.375 10/22/30	1,800,000.00	1,612,044.00	
		UKT 0.5 01/31/29	700,000.00	647,878.00	
		UKT 0.5 10/22/61	100,000.00	63,686.00	
		UKT 0.625 06/07/25	800,000.00	778,112.00	
		UKT 0.625 07/31/35	600,000.00	505,500.00	
		UKT 0.75 07/22/23	1,700,000.00	1,686,281.00	
		UKT 0.875 10/22/29	500,000.00	472,340.00	
		UKT 1 04/22/24	800,000.00	792,104.00	
		UKT 1.125 10/22/73	300,000.00	242,670.00	
		UKT 1.25 07/22/27	200,000.00	196,920.00	
		UKT 1.5 07/22/26	1,100,000.00	1,097,965.00	
		UKT 1.5 07/22/47	2,000,000.00	1,813,300.00	
		UKT 1.625 10/22/28	900,000.00	902,268.00	
		UKT 1.625 10/22/54	500,000.00	467,440.00	
		UKT 1.75 01/22/49	850,000.00	813,960.00	
		UKT 1.75 09/07/37	100,000.00	96,737.00	
		UKT 2 09/07/25	1,100,000.00	1,117,479.00	
		UKT 2.25 09/07/23	2,700,000.00	2,729,295.00	
		UKT 2.5 07/22/65	1,600,000.00	1,947,680.00	
		UKT 2.75 09/07/24	900,000.00	925,551.00	
		UKT 3.25 01/22/44	1,600,000.00	1,951,520.00	
		UKT 3.5 01/22/45	1,250,000.00	1,594,812.50	
		UKT 3.5 07/22/68	1,450,000.00	2,232,391.00	
		UKT 3.75 07/22/52	1,200,000.00	1,698,372.00	
		UKT 4 01/22/60	1,600,000.00	2,550,096.00	
		UKT 4.25 03/07/36	1,050,000.00	1,342,236.00	
		UKT 4.25 06/07/32	300,000.00	368,115.00	
		UKT 4.25 09/07/39	750,000.00	999,225.00	

	UKT 4.25 12/07/27	900,000.00	1,027,566.00	
	UKT 4.25 12/07/40	600,000.00	810,756.00	
	UKT 4.25 12/07/46	1,500,000.00	2,157,660.00	
	UKT 4.25 12/07/49	900,000.00	1,337,913.00	
	UKT 4.25 12/07/55	1,700,000.00	2,703,272.00	
	UKT 4.5 09/07/34	1,100,000.00	1,412,928.00	
	UKT 4.5 12/07/42	1,250,000.00	1,778,462.50	
	UKT 4.75 12/07/30	1,150,000.00	1,433,486.50	
	UKT 4.75 12/07/38	1,000,000.00	1,395,300.00	
	UKT 5 03/07/25	1,300,000.00	1,424,085.00	
	UKT 6 12/07/28	650,000.00	829,055.50	
	イギリス・ポンド小計	44,300,000.00	51,409,373.00 (8,391,037,861)	
イスラエル・シュケル	ILGOV 0.15 07/31/23	5,800,000.00	5,724,716.00	
	ILGOV 1.5 11/30/23	2,200,000.00	2,204,048.00	
	ILGOV 2.25 09/28/28	1,500,000.00	1,499,520.00	
	ILGOV 3.75 03/31/47	4,100,000.00	4,565,186.00	
	ILGOV 6.25 10/30/26	3,300,000.00	3,899,313.00	
	イスラエル・シュケル小計	16,900,000.00	17,892,783.00 (699,901,257)	
デンマーク・クローネ	DGB 0.25 11/15/52	1,800,000.00	1,377,864.00	
	DGB 0.5 11/15/27	8,500,000.00	8,341,390.00	
	DGB 0.5 11/15/29	4,300,000.00	4,162,314.00	
	DGB 1.5 11/15/23	3,000,000.00	3,074,610.00	
	DGB 1.75 11/15/25	3,100,000.00	3,224,589.00	
	DGB 4.5 11/15/39	9,800,000.00	14,971,460.00	
	デンマーク・クローネ小計	30,500,000.00	35,152,227.00 (641,879,665)	
ノルウェー・クローネ	NGB 1.375 08/19/30	3,200,000.00	2,862,912.00	
	NGB 1.5 02/19/26	3,500,000.00	3,352,860.00	
	NGB 1.75 03/13/25	3,000,000.00	2,932,920.00	
	NGB 1.75 09/06/29	4,200,000.00	3,909,990.00	
	NGB 2 04/26/28	9,000,000.00	8,623,170.00	
	NGB 2 05/24/23	3,300,000.00	3,310,593.00	
	NGB 3 03/14/24	4,300,000.00	4,358,824.00	
	ノルウェー・クローネ小計	30,500,000.00	29,351,269.00 (420,016,659)	
スウェーデン・クローナ	SGB 0.75 05/12/28	3,700,000.00	3,555,293.00	
	SGB 0.75 11/12/29	6,400,000.00	6,073,152.00	
	SGB 1 11/12/26	5,800,000.00	5,707,490.00	
	SGB 1.5 11/13/23	6,900,000.00	6,972,588.00	
	SGB 2.5 05/12/25	5,000,000.00	5,196,600.00	
	SGB 3.5 03/30/39	4,600,000.00	5,850,924.00	
	スウェーデン・クローナ小計	32,400,000.00	33,356,047.00 (439,299,139)	

メキシコ・ペソ	MBONO 10 12/05/24	32,000,000.00	32,888,000.00	
	MBONO 5.75 03/05/26	19,000,000.00	17,124,130.00	
	MBONO 7.5 06/03/27	25,000,000.00	23,693,000.00	
	MBONO 7.75 05/29/31	5,000,000.00	4,667,050.00	
	MBONO 7.75 11/23/34	18,000,000.00	16,526,880.00	
	MBONO 8 11/07/47	5,000,000.00	4,552,050.00	
	MBONO 8 12/07/23	21,000,000.00	20,805,540.00	
	MBONO 8.5 05/31/29	23,000,000.00	22,597,730.00	
	MBONO 8.5 11/18/38	40,000,000.00	38,829,600.00	
	メキシコ・ペソ小計	188,000,000.00	181,683,980.00 (1,153,093,716)	
オフショア・人民元	CGB 2.26 02/24/25	5,000,000.00	4,982,350.00	
	CGB 2.47 09/02/24	26,000,000.00	26,059,280.00	
	CGB 2.56 10/21/23	11,000,000.00	11,050,490.00	
	CGB 2.69 08/12/26	32,000,000.00	32,178,880.00	
	CGB 2.8 03/24/29	3,000,000.00	3,002,280.00	
	CGB 2.91 10/14/28	14,000,000.00	14,117,880.00	
	CGB 3.02 05/27/31	17,000,000.00	17,221,850.00	
	CGB 3.72 04/12/51	11,000,000.00	11,704,110.00	
	オフショア・人民元小計	119,000,000.00	120,317,120.00 (2,369,104,251)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA GOVT	700,000.00	708,862.00	
	MALAYSIA GOVT	700,000.00	709,751.00	
	MGS 3.502 05/31/27	7,900,000.00	7,821,632.00	
	MGS 3.955 09/15/25	4,700,000.00	4,783,378.00	
	MGS 4.498 04/15/30	6,000,000.00	6,163,980.00	
	MGS 4.736 03/15/46	6,700,000.00	6,714,070.00	
	マレーシア・リンギット小計	26,700,000.00	26,901,673.00 (798,815,588)	
ポーランド・ズロチ	POLGB 0 04/25/23	300,000.00	283,320.00	
	POLGB 0.25 10/25/26	7,000,000.00	5,292,700.00	
	POLGB 0.75 04/25/25	1,800,000.00	1,516,680.00	
	POLGB 1.25 10/25/30	6,500,000.00	4,479,150.00	
	POLGB 2.25 10/25/24	12,500,000.00	11,276,250.00	
	ポーランド・ズロチ小計	28,100,000.00	22,848,100.00 (668,763,887)	
ユーロ	BGB 0 10/22/31	1,300,000.00	1,157,416.00	
	BGB 0.1 06/22/30	700,000.00	647,171.00	
	BGB 0.4 06/22/40	300,000.00	242,952.00	
	BGB 0.5 10/22/24	1,300,000.00	1,308,177.00	
	BGB 0.65 06/22/71	400,000.00	244,424.00	
	BGB 0.8 06/22/25	300,000.00	303,378.00	
	BGB 0.8 06/22/27	1,000,000.00	1,001,700.00	
	BGB 0.8 06/22/28	1,600,000.00	1,594,640.00	

		BGB 0.9 06/22/29	900,000.00	895,131.00	
		BGB 1 06/22/26	1,800,000.00	1,828,782.00	
		BGB 1 06/22/31	1,300,000.00	1,282,632.00	
		BGB 1.25 04/22/33	1,200,000.00	1,204,812.00	
		BGB 1.45 06/22/37	400,000.00	396,868.00	
		BGB 1.6 06/22/47	650,000.00	636,324.00	
		BGB 1.7 06/22/50	500,000.00	497,155.00	
		BGB 1.9 06/22/38	1,000,000.00	1,058,410.00	
		BGB 2.15 06/22/66	500,000.00	550,155.00	
		BGB 2.25 06/22/23	1,300,000.00	1,339,585.00	
		BGB 2.25 06/22/57	500,000.00	561,035.00	
		BGB 2.6 06/22/24	800,000.00	842,696.00	
		BGB 3 06/22/34	200,000.00	236,952.00	
		BGB 3.75 06/22/45	800,000.00	1,117,744.00	
		BGB 4 03/28/32	500,000.00	630,945.00	
		BGB 4.25 03/28/41	1,000,000.00	1,425,330.00	
		BGB 4.5 03/28/26	700,000.00	809,158.00	
		BGB 5 03/28/35	1,000,000.00	1,424,590.00	
		BGB 5.5 03/28/28	1,100,000.00	1,403,666.00	
		BTPS 0 12/15/24	1,300,000.00	1,264,913.00	
		BTPS 0.35 02/01/25	2,400,000.00	2,356,896.00	
		BTPS 0.5 02/01/26	1,000,000.00	970,630.00	
		BTPS 0.65 10/15/23	2,000,000.00	2,013,140.00	
		BTPS 0.85 01/15/27	1,700,000.00	1,646,688.00	
		BTPS 0.9 04/01/31	2,000,000.00	1,775,340.00	
		BTPS 0.95 08/01/30	1,800,000.00	1,631,160.00	
		BTPS 0.95 09/15/27	800,000.00	769,904.00	
		BTPS 0.95 12/01/31	1,100,000.00	967,890.00	
		BTPS 1.25 12/01/26	800,000.00	791,880.00	
		BTPS 1.45 03/01/36	1,100,000.00	967,164.00	
		BTPS 1.45 05/15/25	700,000.00	706,748.00	
		BTPS 1.45 11/15/24	1,800,000.00	1,821,078.00	
		BTPS 1.5 06/01/25	2,700,000.00	2,733,183.00	
		BTPS 1.6 06/01/26	1,200,000.00	1,210,404.00	
		BTPS 1.65 12/01/30	2,200,000.00	2,099,284.00	
		BTPS 1.7 09/01/51	1,500,000.00	1,182,495.00	
		BTPS 1.85 05/15/24	3,000,000.00	3,071,400.00	
		BTPS 1.85 07/01/25	1,000,000.00	1,021,000.00	
		BTPS 2 02/01/28	3,900,000.00	3,955,068.00	
		BTPS 2 12/01/25	1,300,000.00	1,335,529.00	
		BTPS 2.05 08/01/27	1,500,000.00	1,528,485.00	
		BTPS 2.1 07/15/26	1,000,000.00	1,028,320.00	
		BTPS 2.2 06/01/27	1,300,000.00	1,337,479.00	
		BTPS 2.25 09/01/36	500,000.00	485,125.00	

		BTPS 2.45 09/01/33	1,100,000.00	1,106,017.00	
		BTPS 2.45 09/01/50	900,000.00	835,353.00	
		BTPS 2.5 11/15/25	2,100,000.00	2,194,500.00	
		BTPS 2.5 12/01/24	1,300,000.00	1,353,391.00	
		BTPS 2.7 03/01/47	1,550,000.00	1,546,652.00	
		BTPS 2.8 03/01/67	600,000.00	568,746.00	
		BTPS 2.8 12/01/28	1,000,000.00	1,057,140.00	
		BTPS 2.95 09/01/38	800,000.00	839,480.00	
		BTPS 3 08/01/29	2,700,000.00	2,884,032.00	
		BTPS 3.1 03/01/40	500,000.00	531,845.00	
		BTPS 3.25 09/01/46	1,500,000.00	1,640,955.00	
		BTPS 3.35 03/01/35	850,000.00	931,387.50	
		BTPS 3.45 03/01/48	1,000,000.00	1,127,930.00	
		BTPS 3.5 03/01/30	4,400,000.00	4,870,096.00	
		BTPS 3.75 09/01/24	2,300,000.00	2,460,517.00	
		BTPS 3.85 09/01/49	1,100,000.00	1,319,032.00	
		BTPS 4 02/01/37	2,600,000.00	3,074,188.00	
		BTPS 4.5 03/01/24	1,000,000.00	1,074,710.00	
		BTPS 4.5 03/01/26	1,800,000.00	2,020,968.00	
		BTPS 4.5 05/01/23	2,300,000.00	2,410,584.00	
		BTPS 4.75 08/01/23	2,500,000.00	2,653,325.00	
		BTPS 4.75 09/01/28	2,000,000.00	2,348,460.00	
		BTPS 4.75 09/01/44	1,400,000.00	1,880,858.00	
		BTPS 5 03/01/25	1,000,000.00	1,113,440.00	
		BTPS 5 08/01/34	2,070,000.00	2,653,346.70	
		BTPS 5 08/01/39	1,800,000.00	2,398,716.00	
		BTPS 5 09/01/40	1,700,000.00	2,286,432.00	
		BTPS 5.75 02/01/33	1,700,000.00	2,258,246.00	
		BTPS 6 05/01/31	2,200,000.00	2,893,814.00	
		BTPS 6.5 11/01/27	1,700,000.00	2,138,311.00	
		BTPS 7.25 11/01/26	400,000.00	503,136.00	
		BTPS 9 11/01/23	300,000.00	340,371.00	
		DBR 0 02/15/30	1,300,000.00	1,232,933.00	
		DBR 0 02/15/32	400,000.00	370,236.00	
		DBR 0 05/15/35	4,100,000.00	3,654,904.00	
		DBR 0 08/15/29	2,600,000.00	2,477,540.00	
		DBR 0 08/15/30	5,800,000.00	5,472,996.00	
		DBR 0 08/15/31	1,500,000.00	1,401,030.00	
		DBR 0 08/15/50	2,800,000.00	2,175,908.00	
		DBR 0.25 02/15/27	2,300,000.00	2,270,468.00	
		DBR 0.25 02/15/29	1,800,000.00	1,753,344.00	
		DBR 0.25 08/15/28	1,500,000.00	1,464,900.00	
		DBR 0.5 02/15/25	2,500,000.00	2,517,475.00	
		DBR 0.5 02/15/26	3,100,000.00	3,108,804.00	

DBR 0.5 02/15/28	2,100,000.00	2,086,980.00	
DBR 0.5 08/15/27	3,400,000.00	3,385,856.00	
DBR 1 08/15/24	1,300,000.00	1,325,831.00	
DBR 1 08/15/25	2,050,000.00	2,093,993.00	
DBR 1.25 08/15/48	1,450,000.00	1,580,108.50	
DBR 1.5 05/15/23	1,300,000.00	1,326,273.00	
DBR 1.5 05/15/24	3,600,000.00	3,705,048.00	
DBR 1.75 02/15/24	2,200,000.00	2,270,510.00	
DBR 2 08/15/23	2,000,000.00	2,062,100.00	
DBR 2.5 07/04/44	2,200,000.00	2,936,450.00	
DBR 2.5 08/15/46	2,500,000.00	3,411,375.00	
DBR 3.25 07/04/42	700,000.00	1,010,590.00	
DBR 4 01/04/37	1,800,000.00	2,588,616.00	
DBR 4.25 07/04/39	950,000.00	1,462,867.00	
DBR 4.75 07/04/28	1,600,000.00	2,008,400.00	
DBR 4.75 07/04/34	600,000.00	877,314.00	
DBR 4.75 07/04/40	1,450,000.00	2,394,588.00	
DBR 5.5 01/04/31	900,000.00	1,266,318.00	
DBR 5.625 01/04/28	1,000,000.00	1,284,500.00	
DBR 6.25 01/04/24	1,200,000.00	1,331,604.00	
DBR 6.25 01/04/30	500,000.00	711,870.00	
DBR 6.5 07/04/27	1,000,000.00	1,304,240.00	
FRTR 0 02/25/24	1,900,000.00	1,895,288.00	
FRTR 0 02/25/26	4,300,000.00	4,191,296.00	
FRTR 0 03/25/24	4,800,000.00	4,780,512.00	
FRTR 0 03/25/25	1,900,000.00	1,872,963.00	
FRTR 0 11/25/29	4,500,000.00	4,154,310.00	
FRTR 0 11/25/30	3,900,000.00	3,529,266.00	
FRTR 0 11/25/31	3,400,000.00	3,016,990.00	
FRTR 0.25 11/25/26	3,200,000.00	3,127,584.00	
FRTR 0.5 05/25/25	1,300,000.00	1,299,233.00	
FRTR 0.5 05/25/26	3,500,000.00	3,471,895.00	
FRTR 0.5 05/25/29	200,000.00	193,120.00	
FRTR 0.5 05/25/72	100,000.00	56,365.00	
FRTR 0.75 05/25/28	3,300,000.00	3,271,554.00	
FRTR 0.75 05/25/52	3,000,000.00	2,330,640.00	
FRTR 0.75 11/25/28	3,500,000.00	3,457,475.00	
FRTR 1 05/25/27	2,100,000.00	2,119,236.00	
FRTR 1 11/25/25	2,050,000.00	2,076,465.50	
FRTR 1.25 05/25/34	4,100,000.00	4,034,236.00	
FRTR 1.25 05/25/36	3,700,000.00	3,605,650.00	
FRTR 1.5 05/25/31	2,550,000.00	2,624,562.00	
FRTR 1.5 05/25/50	2,400,000.00	2,308,200.00	
FRTR 1.75 05/25/23	4,200,000.00	4,296,096.00	

		FRTR 1.75 05/25/66	800,000.00	790,816.00	
		FRTR 1.75 06/25/39	2,500,000.00	2,608,100.00	
		FRTR 1.75 11/25/24	2,600,000.00	2,691,416.00	
		FRTR 2 05/25/48	2,000,000.00	2,148,260.00	
		FRTR 2.25 05/25/24	1,700,000.00	1,771,111.00	
		FRTR 2.5 05/25/30	3,500,000.00	3,896,445.00	
		FRTR 2.75 10/25/27	3,850,000.00	4,250,284.50	
		FRTR 3.25 05/25/45	1,400,000.00	1,841,182.00	
		FRTR 3.5 04/25/26	2,500,000.00	2,782,175.00	
		FRTR 4 04/25/55	1,370,000.00	2,159,928.30	
		FRTR 4 04/25/60	1,400,000.00	2,275,504.00	
		FRTR 4 10/25/38	2,000,000.00	2,745,220.00	
		FRTR 4.25 10/25/23	1,000,000.00	1,065,540.00	
		FRTR 4.5 04/25/41	2,000,000.00	2,960,260.00	
		FRTR 4.75 04/25/35	2,200,000.00	3,087,304.00	
		FRTR 5.5 04/25/29	2,350,000.00	3,079,886.50	
		FRTR 5.75 10/25/32	400,000.00	576,956.00	
		FRTR 6 10/25/25	3,000,000.00	3,569,880.00	
		FRTR 8.5 04/25/23	600,000.00	655,032.00	
		IRISH 0.9 05/15/28	700,000.00	697,942.00	
		IRISH 1 05/15/26	600,000.00	607,716.00	
		IRISH 1.1 05/15/29	1,600,000.00	1,606,720.00	
		IRISH 1.3 05/15/33	1,000,000.00	990,180.00	
		IRISH 1.35 03/18/31	500,000.00	508,925.00	
		IRISH 1.5 05/15/50	500,000.00	479,115.00	
		IRISH 1.7 05/15/37	300,000.00	308,805.00	
		IRISH 2 02/18/45	900,000.00	968,886.00	
		IRISH 2.4 05/15/30	600,000.00	661,236.00	
		IRISH 3.4 03/18/24	500,000.00	530,970.00	
		IRISH 5.4 03/13/25	800,000.00	913,272.00	
		NETHER 0 01/15/24	1,000,000.00	1,000,320.00	
		NETHER 0 01/15/27	800,000.00	775,216.00	
		NETHER 0 07/15/30	2,600,000.00	2,411,474.00	
		NETHER 0.25 07/15/25	1,700,000.00	1,690,650.00	
		NETHER 0.25 07/15/29	500,000.00	478,685.00	
		NETHER 0.5 01/15/40	1,700,000.00	1,537,701.00	
		NETHER 0.5 07/15/26	1,700,000.00	1,695,920.00	
		NETHER 0.75 07/15/27	400,000.00	400,880.00	
		NETHER 0.75 07/15/28	1,500,000.00	1,497,585.00	
		NETHER 1.75 07/15/23	800,000.00	821,064.00	
		NETHER 2 07/15/24	1,000,000.00	1,041,410.00	
		NETHER 2.5 01/15/33	600,000.00	688,434.00	
		NETHER 2.75 01/15/47	1,500,000.00	2,057,655.00	
		NETHER 3.75 01/15/42	1,300,000.00	1,914,159.00	

		NETHER 4 01/15/37	1,400,000.00	1,950,060.00	
		NETHER 5.5 01/15/28	700,000.00	887,838.00	
		OBL 0 04/05/24	1,300,000.00	1,298,661.00	
		OBL 0 04/11/25	2,800,000.00	2,774,716.00	
		OBL 0 04/14/23	200,000.00	200,834.00	
		OBL 0 10/09/26	1,100,000.00	1,074,689.00	
		OBL 0 10/10/25	1,800,000.00	1,776,456.00	
		OBL 0 10/13/23	1,600,000.00	1,605,184.00	
		OBL 0 10/18/24	600,000.00	596,844.00	
		RAGB 0 02/20/30	900,000.00	826,137.00	
		RAGB 0 02/20/31	800,000.00	721,392.00	
		RAGB 0 07/15/23	600,000.00	601,716.00	
		RAGB 0.5 02/20/29	550,000.00	531,921.50	
		RAGB 0.5 04/20/27	500,000.00	494,045.00	
		RAGB 0.75 02/20/28	700,000.00	696,080.00	
		RAGB 0.75 03/20/51	900,000.00	751,077.00	
		RAGB 0.75 10/20/26	900,000.00	902,997.00	
		RAGB 0.85 06/30/20	150,000.00	84,864.00	
		RAGB 1.2 10/20/25	1,000,000.00	1,023,800.00	
		RAGB 1.5 02/20/47	700,000.00	716,205.00	
		RAGB 1.5 11/02/86	200,000.00	182,634.00	
		RAGB 1.65 10/21/24	1,200,000.00	1,243,200.00	
		RAGB 1.75 10/20/23	1,000,000.00	1,028,370.00	
		RAGB 2.4 05/23/34	600,000.00	675,066.00	
		RAGB 3.15 06/20/44	500,000.00	674,300.00	
		RAGB 3.8 01/26/62	700,000.00	1,167,852.00	
		RAGB 4.15 03/15/37	600,000.00	829,734.00	
		RAGB 4.85 03/15/26	500,000.00	584,615.00	
		RAGB 6.25 07/15/27	1,000,000.00	1,289,020.00	
		RFGB 0.25 09/15/40	300,000.00	245,988.00	
		RFGB 0.5 04/15/26	800,000.00	797,088.00	
		RFGB 0.5 09/15/28	400,000.00	389,588.00	
		RFGB 0.5 09/15/29	800,000.00	771,576.00	
		RFGB 0.75 04/15/31	500,000.00	485,450.00	
		RFGB 1.375 04/15/47	300,000.00	307,266.00	
		RFGB 1.5 04/15/23	200,000.00	203,738.00	
		RFGB 2 04/15/24	1,000,000.00	1,037,860.00	
		RFGB 2.625 07/04/42	1,000,000.00	1,230,310.00	
		RFGB 2.75 07/04/28	400,000.00	446,384.00	
		RFGB 4 07/04/25	600,000.00	669,504.00	
		SPGB 0 01/31/25	500,000.00	491,540.00	
		SPGB 0.25 07/30/24	1,400,000.00	1,393,910.00	
		SPGB 0.5 04/30/30	1,000,000.00	932,860.00	
		SPGB 0.5 10/31/31	1,400,000.00	1,261,204.00	

		SPGB 0.8 07/30/27	400,000.00	393,536.00	
		SPGB 1 10/31/50	300,000.00	226,425.00	
		SPGB 1.2 10/31/40	700,000.00	608,601.00	
		SPGB 1.25 10/31/30	3,000,000.00	2,950,380.00	
		SPGB 1.3 10/31/26	3,100,000.00	3,146,376.00	
		SPGB 1.4 04/30/28	2,200,000.00	2,228,424.00	
		SPGB 1.4 07/30/28	1,600,000.00	1,618,848.00	
		SPGB 1.45 04/30/29	2,000,000.00	2,022,760.00	
		SPGB 1.45 10/31/27	2,600,000.00	2,643,160.00	
		SPGB 1.45 10/31/71	400,000.00	274,568.00	
		SPGB 1.5 04/30/27	700,000.00	714,063.00	
		SPGB 1.6 04/30/25	1,400,000.00	1,439,508.00	
		SPGB 1.85 07/30/35	2,700,000.00	2,702,160.00	
		SPGB 1.95 04/30/26	2,000,000.00	2,079,820.00	
		SPGB 1.95 07/30/30	1,700,000.00	1,770,125.00	
		SPGB 2.15 10/31/25	2,400,000.00	2,508,888.00	
		SPGB 2.35 07/30/33	1,500,000.00	1,596,165.00	
		SPGB 2.7 10/31/48	1,050,000.00	1,174,498.50	
		SPGB 2.75 10/31/24	2,100,000.00	2,221,170.00	
		SPGB 2.9 10/31/46	1,700,000.00	1,970,079.00	
		SPGB 3.45 07/30/66	1,300,000.00	1,611,428.00	
		SPGB 3.8 04/30/24	1,400,000.00	1,496,754.00	
		SPGB 4.2 01/31/37	1,650,000.00	2,150,758.50	
		SPGB 4.4 10/31/23	2,000,000.00	2,131,840.00	
		SPGB 4.65 07/30/25	1,800,000.00	2,023,470.00	
		SPGB 4.7 07/30/41	1,500,000.00	2,154,930.00	
		SPGB 4.8 01/31/24	3,000,000.00	3,239,340.00	
		SPGB 4.9 07/30/40	1,200,000.00	1,745,796.00	
		SPGB 5.15 10/31/28	1,500,000.00	1,866,600.00	
		SPGB 5.15 10/31/44	1,000,000.00	1,566,760.00	
		SPGB 5.75 07/30/32	1,500,000.00	2,088,195.00	
		SPGB 5.9 07/30/26	500,000.00	604,100.00	
		SPGB 6 01/31/29	2,200,000.00	2,889,128.00	
	ユーロ小計		394,690,000.00	421,621,364.00 (57,277,262,299)	
国債証券合計				155,013,648,989 (155,013,648,989)	
合　計				155,013,648,989 (155,013,648,989)	

（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	196銘柄	48.4%	48.9%

カナダ・ドル	国債証券	21銘柄	2.0%	2.0%
オーストラリア・ドル	国債証券	18銘柄	1.6%	1.6%
シンガポール・ドル	国債証券	11銘柄	0.4%	0.4%
イギリス・ポンド	国債証券	43銘柄	5.4%	5.4%
イスラエル・シュケル	国債証券	5銘柄	0.4%	0.5%
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	0.3%	0.3%
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	8銘柄	1.5%	1.5%
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	5銘柄	0.4%	0.4%
ユーロ	国債証券	261銘柄	36.6%	36.9%

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

マネーインカム・マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

	（2021年4月13日現在）	（2022年4月13日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	353,667,650	11,627,715
コール・ローン	183,291,158	446,032,013
国債証券	220,025,960	300,054,000
特殊債券	1,517,370,344	1,196,252,766
未収利息	3,234,062	1,138,662
前払費用	-	237,925
流動資産合計	2,277,589,174	1,955,343,081
資産合計	2,277,589,174	1,955,343,081
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,200,000	4,684,078
未払利息	502	-
その他未払費用	4,950	1,766
流動負債合計	1,205,452	4,685,844
負債合計	1,205,452	4,685,844
純資産の部		
元本等		
元本	2,257,314,469	1,935,317,393
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	19,069,253	15,339,844
元本等合計	2,276,383,722	1,950,657,237
純資産合計	2,276,383,722	1,950,657,237
負債純資産合計	2,277,589,174	1,955,343,081

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2021年4月14日 至 2022年4月13日
１．有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、特殊債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。

（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4月13日現在）	（2022年4月13日現在）
１．当計算期間の末日における受益権の総数	2,257,314,469口	1,935,317,393口
２．１単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　1.0084円 （１万口当たりの純資産額10,084円）	1口当たり純資産額　1.0079円 （１万口当たりの純資産額10,079円）

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	自 2021年4月14日 至 2022年4月13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、特殊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	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。 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、上下限値、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。 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。
４．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	（2022年4月13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、特殊債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自　2021年4月14日 至　2022年4月13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4月13日現在）	
開示対象ファンドの 期首における当該親投資信託の元本額	2,617,198,028円
同期中における追加設定元本額	1,166,758,748円
同期中における一部解約元本額	1,526,642,307円
2021年4月13日現在の元本の内訳	
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）	100,839,042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）	116,052,823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）	47,825,996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）	32,545,911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）	20,369,659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）	38,075,492円
米国小型ハイクオリティファンド（毎月決算型）	99,128円
米国小型ハイクオリティファンド（資産成長型）	297,384円
ＳＭＡＭ・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	890,895,719円
ＳＭＡＭ・バランス先物ファンドＶＡ２０＜適格機関投資家限定＞	164,438,276円
ＳＭＡＭ・ＦＧマネーファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	845,875,039円
合　計	2,257,314,469円

（2022年4月13日現在）
開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	2,257,314,469円
同期中における追加設定元本額	955,084,096円
同期中における一部解約元本額	1,277,081,172円
2022年4月13日現在の元本の内訳	
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	21,805,906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）	102,779,034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）	162,087,175円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３０（４資産タイプ）	89,556,632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）	42,692,099円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ）	29,057,907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）	49,084,616円
米国小型ハイクオリティファンド（毎月決算型）	99,128円
米国小型ハイクオリティファンド（資産成長型）	297,384円
ＳＭＡＭ・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	858,040,993円
ＳＭＡＭ・ＦＧマネーファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	579,816,519円
合　計	1,935,317,393円

（３）附属明細表

①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	１０５５国庫短期証券	100,000,000	100,008,900	
	１０６２国庫短期証券	100,000,000	100,018,800	
	１０６７国庫短期証券	100,000,000	100,026,300	
	国債証券　小計		300,054,000	
特殊債券	１９　政保政策投資Ｃ	100,000,000	100,667,700	
	１６３　政保道路機構	100,000,000	100,127,300	
	１６６　政保道路機構	100,000,000	100,197,100	
	１７０　政保道路機構	100,000,000	100,326,100	
	１７７　政保道路機構	100,000,000	100,546,300	
	１８０　政保道路機構	100,000,000	100,557,200	
	１８２　政保道路機構	123,000,000	123,870,102	
	１８９　政保道路機構	100,000,000	100,615,000	
	４０政保地方公共団	69,000,000	69,252,264	
	４２　政保日本政策	200,000,000	200,054,800	
	２２９　政保預金保険	100,000,000	100,038,900	
	特殊債券　小計		1,196,252,766	
合　計			1,496,306,766	

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）

2022年4月28日現在

Ⅰ　資産総額	2,119,257,982円
Ⅱ　負債総額	931,401円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	2,118,326,581円
Ⅳ　発行済口数	1,405,399,561口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） （１万口当たり純資産額）	1.5073円 （15,073円）

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

イ　名義書換
該当事項はありません。

ロ　受益者名簿
作成しません。

ハ　受益者に対する特典
ありません。

ニ　受益権の譲渡および譲渡制限等

（イ）受益権の譲渡

ａ．受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

ｂ．上記ａの申請のある場合には、上記ａの振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記ａの振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

ｃ．上記ａの振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めた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。

第二部【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4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。

ハ　会社の機構

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

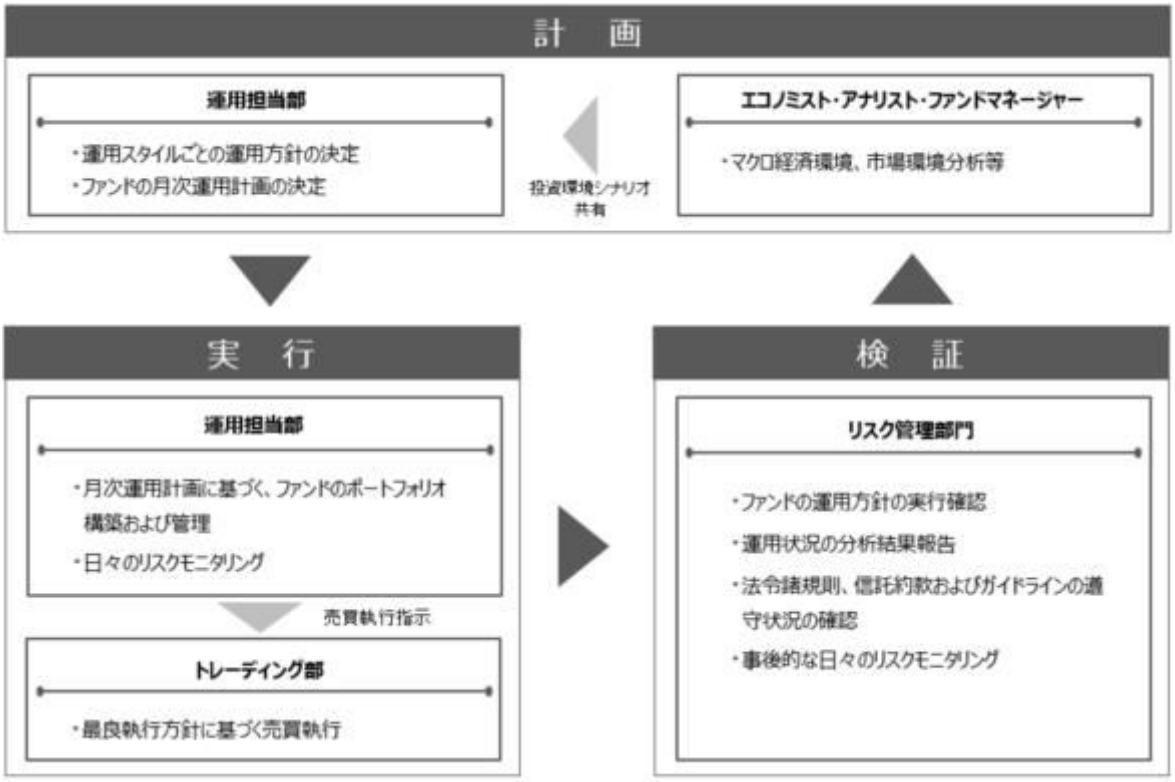
取締役の任期は、選任後１年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

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

ニ　投資信託の運用の流れ



２【事業の内容及び営業の概況】

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

2022年4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	720	9,142,021
単位型株式投資信託	100	496,669
追加型公社債投資信託	1	25,912
単位型公社債投資信託	188	367,669
合　計	1,009	10,032,273

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。

2　当社は、当事業年度（2021年４月１日から2022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ます。

（１）【貸借対照表】

（単位：千円）

		前事業年度 （2021年３月31日）	当事業年度 （2022年３月31日）
資産の部			
流動資産			
現金及び預金		33,048,142	49,008,279
顧客分別金信託		300,036	300,041
前払費用		449,748	475,266
未収入金		132,419	103,809
未収委託者報酬		9,936,096	12,125,117
未収運用受託報酬		2,247,156	2,437,063
未収投資助言報酬		398,108	388,639
未収収益		39,975	36,700
その他の流動資産		6,981	18,458
流動資産合計		46,558,665	64,893,375
固定資産			
有形固定資産	※１		
建物		1,509,450	1,433,442
器具備品		870,855	653,985
土地		710	710
リース資産		13,483	7,357

建設仮勘定	-	5,500
有形固定資産合計	2,394,500	2,100,996
無形固定資産		
ソフトウェア	1,347,889	2,766,476
ソフトウェア仮勘定	1,029,033	100,616
のれん	3,654,491	3,349,950
顧客関連資産	15,671,890	13,558,615
電話加入権	12,727	12,716
商標権	48	42
無形固定資産合計	21,716,080	19,788,417
投資その他の資産		
投資有価証券	22,866,282	14,212,354
関係会社株式	11,246,398	11,246,398
長期差入保証金	1,409,091	1,414,646
長期前払費用	116,117	77,936
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	35,707,619	27,021,065
固定資産合計	59,818,200	48,910,479
資産合計	106,376,866	113,803,855

（単位：千円）

	前事業年度 （2021年３月31日）	当事業年度 （2022年３月31日）
負債の部		
流動負債		
リース債務	5,153	3,567
顧客からの預り金	20,077	6,045
その他の預り金	169,380	196,515
未払金		
未払収益分配金	1,646	1,969
未払償還金	43,523	152
未払手数料	4,480,697	5,545,582
その他未払金	270,290	48,893
未払費用	5,940,121	7,379,404
未払消費税等	235,647	1,133,332
未払法人税等	762,648	2,455,291
賞与引当金	1,516,622	2,100,323
資産除去債務	-	7,192
その他の流動負債	9,710	40,396
流動負債合計	13,455,519	18,918,667
固定負債		
リース債務	9,678	4,525
繰延税金負債	2,566,958	1,279,409
退職給付引当金	5,258,448	5,084,506
その他の固定負債	40,950	4,620
固定負債合計	7,876,035	6,373,062
負債合計	21,331,554	25,291,730
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	73,466,962

資本剰余金合計	90,555,984	82,095,946
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	-
別途積立金	1,476,959	-
繰越利益剰余金	△10,281,242	3,834,794
利益剰余金合計	△8,460,037	4,119,040
株主資本計	84,095,946	88,214,986
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	949,365	297,138
評価・換算差額等合計	949,365	297,138
純資産合計	85,045,311	88,512,124
負債・純資産合計	106,376,866	113,803,855

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	前事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）	当事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	50,610,457	66,139,024
運用受託報酬	9,450,169	9,652,634
投資助言報酬	1,270,584	1,256,334
その他営業収益		
サービス支援手数料	200,807	199,046
その他	32,820	32,936
営業収益計	61,564,839	77,279,976
営業費用		
支払手数料	22,784,919	30,522,133
広告宣伝費	365,317	330,161
調査費		
調査費	3,061,987	3,196,921
委託調査費	7,810,157	12,192,048
営業雑経費		
通信費	95,163	67,600
印刷費	554,920	494,834
協会費	40,044	34,433
諸会費	29,473	30,488
情報機器関連費	4,562,612	4,767,504
販売促進費	23,614	31,930
その他	163,332	181,301
営業費用合計	39,491,542	51,849,358
一般管理費		
給料		
役員報酬	277,027	263,893
給料・手当	9,280,730	8,664,828
賞与	950,630	991,916
賞与引当金繰入額	1,501,855	2,100,323
交際費	11,815	12,301
寄付金	949	29,273
事務委託費	844,255	1,422,189
旅費交通費	21,023	16,863

租税公課	389,819	476,729
不動産賃借料	1,639,529	1,289,256
退職給付費用	790,144	632,559
固定資産減価償却費	3,040,894	3,133,951
のれん償却費	2,645,986	304,540
諸経費	608,206	256,994
一般管理費合計	22,002,869	19,595,622
営業利益	70,426	5,834,995

（単位：千円）

		前事業年度 （自　2020年４月１日 至　2021年３月31日）	当事業年度 （自　2021年４月１日 至　2022年３月31日）
営業外収益			
受取配当金		13,164	7,666
受取利息		2,736	1,836
時効成立分配金・償還金		88,335	43,406
原稿・講演料		2,603	2,587
投資有価証券償還益		57,388	383,608
投資有価証券売却益		162,941	911,268
為替差益		-	4,673
雑収入		72,933	81,640
営業外収益合計		400,104	1,436,686
営業外費用			
投資有価証券償還損		11,762	146,219
投資有価証券売却損		34,473	81,384
為替差損		766	-
雑損失		1,240	2,866
営業外費用合計		48,243	230,470
経常利益		422,288	7,041,212
特別損失			
固定資産除却損	※１	54,493	83,651
減損損失	※２	28,097,346	-
システム統合関連費用	※３	-	375,636
早期退職費用	※４	216,200	260,075
本社移転費用		127,044	-
その他特別損失		5,460	67,000
特別損失合計		28,500,544	786,362
税引前当期純利益又は税引前当期純損失（△）		△28,078,256	6,254,849
法人税、住民税及び事業税		1,549,173	3,101,482
法人税等調整額		△693,192	△965,673
法人税等合計		855,980	2,135,809
当期純利益又は当期純損失（△）		△28,934,237	4,119,040

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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	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

当事業年度（自　2021年４月１日　至　2022年３月31日）

（単位：千円）

	株主資本							
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			
		資本準備金	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
当期変動額								
剰余金の配当								
欠損填補			△8,460,037	△8,460,037				8,460,037
当期純利益								4,119,040
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期変動額（純額）								
当期変動額合計	－	－	△8,460,037	△8,460,037	－	△60,000	△1,476,959	14,116,037
当期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	－	－	3,834,794

	株主資本	評価・換算差額等	

	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	純資産合計
	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
当期変動額					
剰余金の配当					
欠損填補	8,460,037	－			－
当期純利益	4,119,040	4,119,040			4,119,040
任意積立金の取崩	－	－			－
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）			△652,227	△652,227	△652,227
当期変動額合計	12,579,078	4,119,040	△652,227	△652,227	3,466,812
当期末残高	4,119,040	88,214,986	297,138	297,138	88,512,124

[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。

①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。

②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。

(会計方針の変更)

「収益認識会計基準」等を当事業年度の期首から適用し、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当事業年度の財務諸表に与える影響はありません。なお、収益認識会計基準第89-3項に定める経過的な取扱いに従って、前事業年度に係る「収益認識関係」注記については記載しておりません。

(貸借対照表関係)

※１　有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2021年３月31日)	当事業年度 (2022年３月31日)
建物	102,329千円	210,548千円
器具備品	1,153,649千円	1,309,352千円
リース資産	2,830千円	6,073千円

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 (2021年３月31日)	当事業年度 (2022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 (2021年３月31日)	当事業年度 (2022年３月31日)

Sumitomo Mitsui DS Asset Management (USA)Inc.	93,374千円	57,356千円

(損益計算書関係)

※１　固定資産除却損

	前事業年度 （自 2020年４月１日 至 2021年３月31日）	当事業年度 （自 2021年４月１日 至 2022年３月31日）
建物	18,278千円	－千円
器具備品	28,604千円	0千円
リース資産	－千円	－千円
ソフトウェア	7,610千円	83,651千円
ソフトウェア仮勘定	－千円	－千円

※２　減損損失

前事業年度において、次のとおり減損損失を計上しております。

（単位：千円）

場所	用途	種類	減損損失
－	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。

当事業年度において計上した減損損失はありません。

※３　システム統合関連費用

社内システム統合に伴うものであり、主にデータの移行費用などであります。

※４　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。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(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

当事業年度(自 2021年４月１日　至 2022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

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	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年６月28日 定時株主総会	普通株式	2,540,254	75.00	2022年 ３月31日	2022年 ６月29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 （2021年３月31日）	当事業年度 （2022年３月31日）
１年以内	1,194,699	1,166,952
１年超	3,497,258	2,323,090
合計	4,691,958	3,490,042

(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。

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

①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。

②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（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			
①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	－

当事業年度（2022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	49,008,279	49,008,279	－
(2)顧客分別金信託	300,041	300,041	－
(3)未収委託者報酬	12,125,117	12,125,117	－
(4)未収運用受託報酬	2,437,063	2,437,063	－
(5)未収投資助言報酬	388,639	388,639	－
(6)投資有価証券			
①その他有価証券	14,172,545	14,172,545	－
資産計	78,431,686	78,431,686	－
(1)顧客からの預り金	6,045	6,045	－
(2)未払手数料	5,545,582	5,545,582	－
負債計	5,551,627	5,551,627	－

(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。

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 (2021年３月31日)	当事業年度 (2022年３月31日)
その他有価証券		
非上場株式	39,809	39,809
合計	39,809	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)①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)①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（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	－	－

当事業年度（2022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	49,008,279	－	－	－
顧客分別金信託	300,041	－	－	－
未収委託者報酬	12,125,117	－	－	－
未収運用受託報酬	2,437,063	－	－	－
未収投資助言報酬	388,639	－	－	－
合計	64,259,140	－	－	－

(有価証券関係)

１.子会社株式

前事業年度（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。

当事業年度（2022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（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	16,097,433	14,397,606	1,699,827
小計	16,097,433	14,397,606	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	6,729,039	6,994,762	△265,723
小計	6,729,039	6,994,762	△265,723
合計	22,826,472	21,392,369	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。

当事業年度（2022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	9,299,062	8,672,725	626,337
小計	9,299,062	8,672,725	626,337
(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	4,873,482	5,039,817	△166,335
小計	4,873,482	5,039,817	△166,335
合計	14,172,545	13,712,543	460,001

（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 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

当事業年度(自 2021年４月１日　至 2022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
4,082,976	911,268	81,384

（単位：千円）

償還額	償還益の合計額	償還損の合計額
7,183,410	383,608	146,219

４．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、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。

当事業年度において、減損処理を行った有価証券はありません。

(退職給付関係)

１．採用している退職給付制度の概要

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

２．確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（単位：千円）

	前事業年度 （自 2020年４月１日 至 2021年３月31日）	当事業年度 （自 2021年４月１日 至 2022年３月31日）
退職給付債務の期首残高	5,299,814	5,258,448
勤務費用	476,308	454,611
利息費用	－	1,013
数理計算上の差異の発生額	67,476	△34,553
退職給付の支払額	△585,151	△595,013
過去勤務費用の発生額	－	－
合併による発生額	－	－
退職給付債務の期末残高	5,258,448	5,084,506

(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 （2021年３月31日）	当事業年度 （2022年３月31日）
非積立型制度の退職給付債務	5,258,448	5,084,506
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	5,258,448	5,084,506

(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 2020年４月１日 至 2021年３月31日）	当事業年度 （自 2021年４月１日 至 2022年３月31日）
勤務費用	476,308	454,611
利息費用	－	1,013
数理計算上の差異の費用処理額	67,476	△34,553
その他	246,359	211,487
確定給付制度に係る退職給付費用	790,144	632,559

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

(4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表わしております。）

	前事業年度 （自 2020年４月１日 至 2021年３月31日）	当事業年度 （自 2021年４月１日 至 2022年３月31日）
割引率	0.020%	0.130%

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239,162千円、当事業年度237,296千円であります。

(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	当事業年度

	（2021年３月31日）	（2022年３月31日）
繰延税金資産		
退職給付引当金	1,610,136	1,556,876
賞与引当金	464,389	643,119
調査費	247,208	279,809
未払金	206,090	284,070
未払事業税	66,891	139,522
ソフトウェア償却	90,431	107,998
子会社株式評価損	114,876	114,876
その他有価証券評価差額金	131,391	93,946
その他	35,930	28,056
繰延税金資産小計	2,967,346	3,248,274
評価性引当額（注）	△218,966	△189,102
繰延税金資産合計	2,748,380	3,059,171
繰延税金負債		
無形固定資産	4,798,732	4,151,648
資産除去債務	-	825
その他有価証券評価差額金	516,605	186,107
繰延税金負債合計	5,315,338	4,338,581
繰延税金資産（負債）の純額	△2,566,958	△1,279,409

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 （2021年３月31日）	当事業年度 （2022年３月31日）
法定実効税率	税引前当期純損失のため記載を省略しております。	30.6%
（調整）		
交際費等永久に損金に算入されない項目		1.6
住民税均等割等		0.1
のれん償却費		1.4
その他		0.2
税効果会計適用後の法人税等の負担率		34.1

(収益認識関係)

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)

前事業年度(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

①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。

②有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の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 2021年４月１日 至2022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	66,139,024	9,652,634	1,256,334	231,982	77,279,976

(2)地域ごとの情報

①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。

②有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の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 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）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 2021年４月１日 至 2022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	4,727,024	未払手数料	1,098,966
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	8,397,864	未払手数料	1,661,614

（注）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 2020年４月１日 至 2021年３月31日）	当事業年度 （自 2021年４月１日 至 2022年３月31日）
１株当たり純資産額	2,510.93円	2,613.28円
１株当たり当期純利益又は１株当たり当期純損失（△）	△854.27円	121.61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、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。
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、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 2020年４月１日 至 2021年３月31日）	当事業年度 （自 2021年４月１日 至 2022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）	△28,934,237	4,119,040
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）	△28,934,237	4,119,040
期中平均株式数（株）	33,870,060	33,870,060

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

該当ありません。

ロ　訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実

該当ありません。

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

イ　受託会社

（イ）名称	三井住友信託銀行株式会社
（ロ）資本金の額	342,037百万円（2021年3月末現在）
（ハ）事業の内容	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

・　名称	株式会社日本カストディ銀行
・　資本金の額	51,000百万円（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。

ロ　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
ａｕカブコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社ＳＢＩ証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
岡三証券株式会社	5,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	7,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	12,200	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,945	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
住友生命保険相互会社	639,000	保険業法に基づき、生命保険業を営んでいます。

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

2【関係業務の概要】

イ　受託会社
信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

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

3【資本関係】

（持株比率５％以上を記載しています。）
販売会社である住友生命保険相互会社は、委託会社株式を10.4%保有しています。

第３【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2021年 7月 8日	有価証券届出書
2021年 7月 8日	有価証券報告書
2022年 1月 6日	有価証券届出書
2022年 1月 6日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2022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
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

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2022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。

その他の記載内容
　その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

　当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

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6月28日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

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ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）の2021年4月14日から2022年4月13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、ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）の2022年4月13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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

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。