

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年1月23日提出
【発行者名】	三井住友D S アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 猿田 隆
【本店の所在の場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【事務連絡者氏名】	土屋 裕子
【電話番号】	03-6205-1649
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	アセットアロケーション・ファンド（安定型） アセットアロケーション・ファンド（安定成長型） アセットアロケーション・ファンド（成長型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	アセットアロケーション・ファンド（安定型） 2兆5,000億円を上限とします。 アセットアロケーション・ファンド（安定成長型） 2兆5,000億円を上限とします。 アセットアロケーション・ファンド（成長型） 2兆5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

## (1)【ファンドの名称】

アセットアロケーション・ファンド（安定型）

アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

アセットアロケーション・ファンド（成長型）

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

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

## (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

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

## (3)【発行（売出）価額の総額】

各ファンド2兆5,000億円を上限とします。

## (4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

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

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

**（５）【申込手数料】**

原則として、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）に、1.1%（税抜き1.0%）を上限として、販売会社がそれぞれ別に定める申込手数料率を乗じて得た額となります。

累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は無手数料となります。

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

**（６）【申込単位】**

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

**（７）【申込期間】**

2023年1月24日から2023年7月20日まで

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

**（８）【申込取扱場所】**

販売会社において申込みを取り扱います。

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

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

**（９）【払込期日】**

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

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

**（１０）【払込取扱場所】**

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

**（１１）【振替機関に関する事項】**

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

## ( 1 2 ) 【その他】

## イ 申込証拠金

ありません。

## ロ 日本以外の地域における募集

ありません。

## ハ スイッチング

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

## ニ お申込不可日

上記にかかわらず、取得申込日が以下のいずれかに当たる場合には、ファンドの取得申込みはできません（また、該当日には、解約請求のお申込みもできません。）。

・ニューヨークの取引所の休業日

・ニューヨークの銀行の休業日

## ホ クーリング・オフ制度（金融商品取引法第37条の6）の適用

ありません。

## ヘ 振替受益権について

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

## （参考：投資信託振替制度）

・ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理するもので、ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行われます。

・受益証券は発行されませんので、盗難や紛失のリスクが削減されます（原則として受益証券を保有することはできません。）。

・ファンドの設定、解約等における決済リスクが削減されます。

・振替口座簿に記録されますので、受益権の所在が明確になります。

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

## (イ) 当ファンドが該当する商品分類

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

## (ロ) 当ファンドが該当する属性区分

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

## 商品分類表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

## (2)【ファンドの沿革】

2015年4月17日 信託契約締結、設定、運用開始。

## (3)【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(イ) 委託会社 「三井住友DSアセットマネジメント株式会社」

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

(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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

(ハ) 販売会社

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

〔参考情報：投資顧問会社〕

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

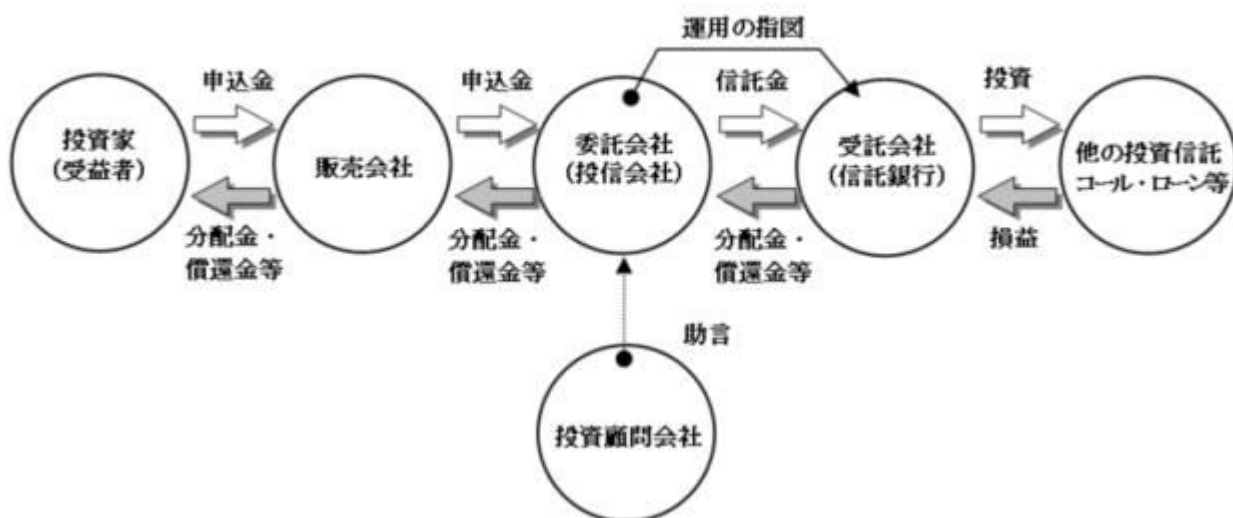
日興グローバルラップ株式会社

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

エドモン・ドゥ・ロスチャイルド・アセット・マネジメント(ルクセンブルグ)

世界経済の見通しと組入資産の投資見通しに関する投資助言を行います。

## 運営の仕組み



## □ 委託会社の概況

## (イ) 資本金の額

20億円（2022年11月30日現在）

## (ロ) 会社の沿革

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

## (ハ) 大株主の状況

(2022年11月30日現在)

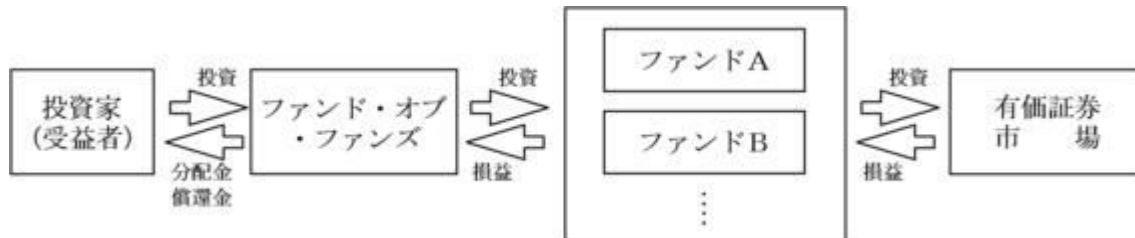
名称	住所	所有株式数 (株)	比率 (%)
株式会社三井住友フィナンシャルグループ	東京都千代田区丸の内一丁目1番2号	16,977,897	50.1
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	7,946,406	23.5
三井住友海上火災保険株式会社	東京都千代田区神田駿河台三丁目9番地	5,080,509	15.0
住友生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区城見一丁目4番35号	3,528,000	10.4
三井住友信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	337,248	1.0



## 八 ファンドの運用形態（ファンド・オブ・ファンズによる運用）

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

### 〔ファンド・オブ・ファンズによる運用〕



## 2【投資方針】

### （1）【投資方針】

#### イ 基本方針

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

#### ロ 投資態度

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

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

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

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

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

（ニ）投資信託証券への投資は、高位を保つことを原則とします。

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

## ファンドの特色

# 1

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

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

債券

国内債券

先進国債券(除く日本)\*1

新興国債券\*2

ハイイールド債券\*2

株式

国内株式

先進国株式(除く日本)

新興国株式

リート

国内リート

外国リート

\*1 対円での為替ヘッジを行う投資信託証券を組み入れることがあります。

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

# 2

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

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

### リスク態度指数

市場のリスク選好度合いを計るための指数です。リスクオン局面(リスク選好的な局面)とリスクオフ局面(リスク回避的な局面)を判断します。

3

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

**安定型** 信託財産の安定性を重視した運用を行います。

**安定成長型** 信託財産の安定性と収益性のバランスを重視した運用を行います。

**成長型** 信託財産の収益性を重視した運用を行います。

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

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

### ファンドのしくみ

□ ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。

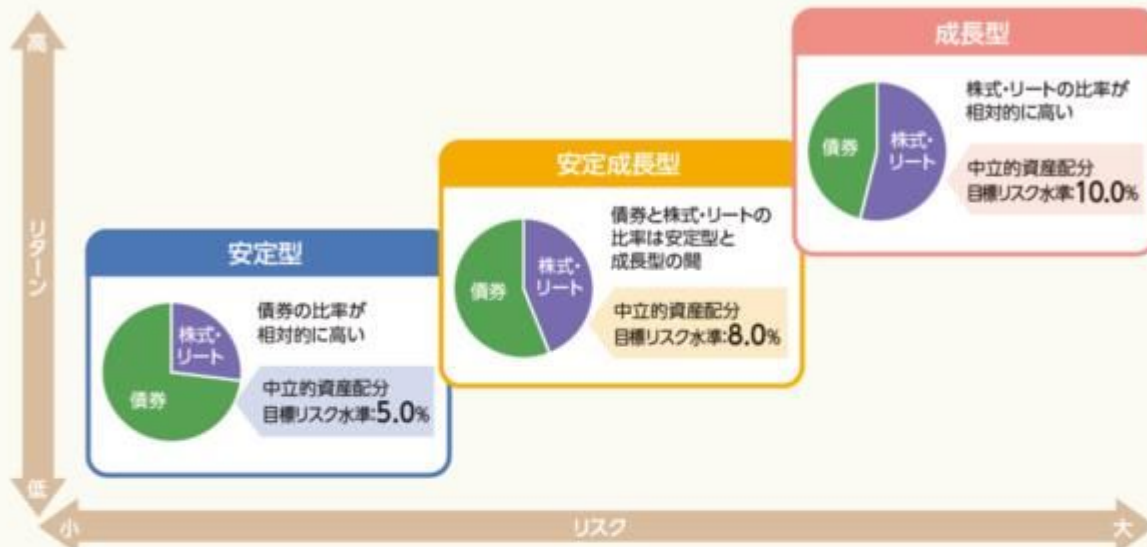


※日興グローバルラップは委託会社の子会社(100%出資)です。

## お客様の投資スタイルに合わせて3つのファンドから選択

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

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



[ 各ファンドの3つの基本資産配分の目標リスク水準について ]

### 各ファンドの目標リスク水準

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

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

(出所)日興グローバルラップ

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

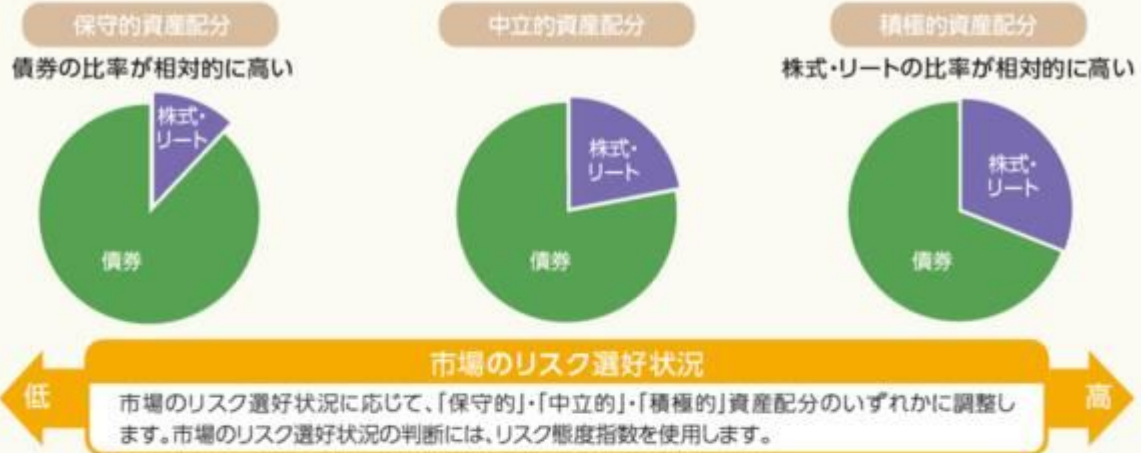
※上記の目標リスク水準は2022年2月末現在のものであり、今後変更される場合があります。



## 資産配分の調整について

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

### [ 市場のリスク選好状況に応じた資産配分の調整 ]

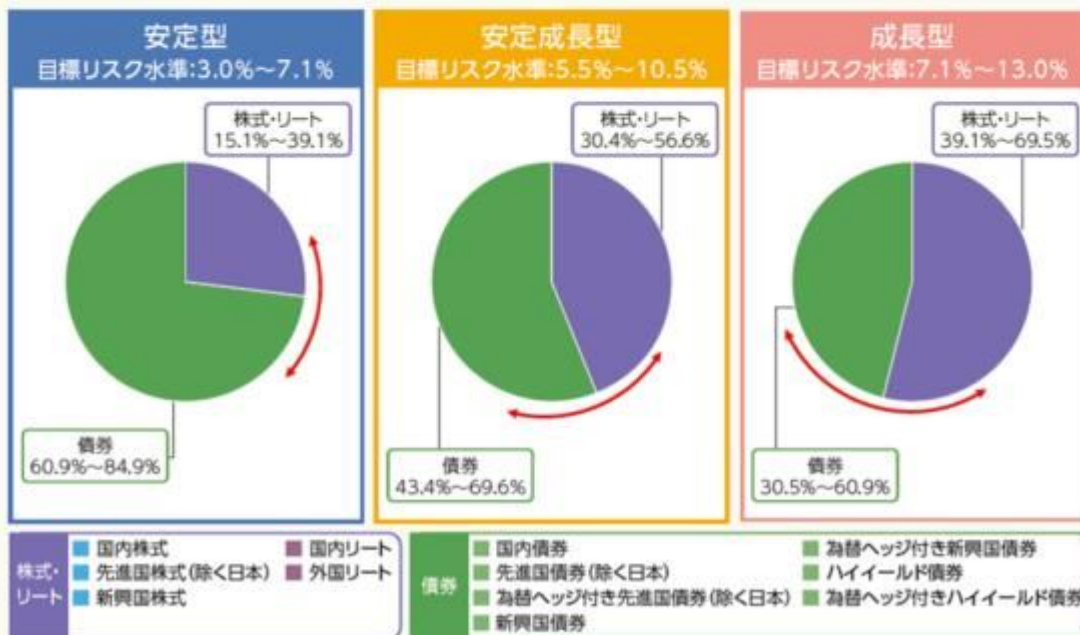


※資産配分の決定にあたっては、エドモン・ドゥ・ロスチャイルド・アセット・マネジメント(ルクセンブルグ)から投資助言を受けます。

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

## ポートフォリオのイメージ

### ▶ 資産配分



(出所)日興グローバルラップ

※上記はイメージであり、実際とは異なる場合があります。

※上記は2022年2月に日興グローバルラップから受けた投資助言に基づく資産配分であり、今後変更される場合があります。

## 運用プロセス

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



※上記の運用プロセスは2022年11月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

## (2) 【投資対象】

## イ 投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

1. 有価証券
2. 約束手形
3. 金銭債権

(ロ) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1. 為替手形

## ロ 投資対象とする有価証券

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

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

ます。)

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

#### 八 投資対象とする金融商品

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

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

#### 〔参考情報：投資対象とする投資信託の概要〕

●すべての投資信託証券に投資するとは限りません。

##### ▶ 債券

###### 国内債券

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

###### 先進国債券（除く日本）…為替ヘッジなし

ファンド名	外国債券パッシブ・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>● 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。</li> <li>● ベンチマーク採用国の国債を主要投資対象とします。</li> <li>● 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。</li> </ul>
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.1%
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社

###### 為替ヘッジ付き先進国債券（除く日本）…為替ヘッジあり

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



## 新興国債券…為替ヘッジなし\*1

ファンド名	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>● JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指します。</li> <li>● 米ドル建ての新興国の公社債を主要投資対象とします。</li> <li>● 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。</li> </ul>
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.2%
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社

ファンド名	パンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF
形態	米国籍外国投資信託(米ドル建て)
運用の基本方針	ベンチマークのパフォーマンスへの連動を目指します。
ベンチマーク	ブルームバーグ米ドル建て新興市場政府債RIC基準インデックス
管理費用*2	年0.20%程度
運用会社	ザ・パンガード・グループ・インク
購入の可否*3	日本において一般投資者の購入が可能です。

## ハイイールド債券…為替ヘッジなし\*1

ファンド名	SPDR ブルームバーグ・ハイ・イールド債券ETF
形態	米国籍外国投資信託(米ドル建て)
運用の基本方針	ベンチマークの値動きと利回りに、経費控除前で、概ね連動する投資成果を上げることを目指します。
ベンチマーク	ブルームバーグ・ハイ・イールド・ベリリー・リキッド・インデックス
管理費用*2	年0.40%程度
運用会社	SSgA ファンズ・マネジメント・インク
購入の可否*3	日本において一般投資者の購入が可能です。

- \*1 上記の投資信託証券を組み入れた場合、安定型・安定成長型・成長型の各ファンドにおいて対円での為替ヘッジを行うことがあります。
- \*2 管理費用とは、各ETFの運用管理費用およびその他費用を各ETFの平均純資産総額で除したもので、本書の数値は各ETFの直近の目録見書等で開示されているものです。
- \*3 外国籍のETFは、海外の上場有価証券を取り次ぐことのできる証券会社を通じて、日本国内の一般の投資者が、直接購入することができるものがあります。直接購入される際は、売買委託手数料(証券会社ごとに異なります。)がかかります。また、円貨と外貨を交換する際に、証券会社が別途定める手数料がかかります。



## ▶ 株式

## 国内株式

ファンド名	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)
形態	国内籍親投資信託
運用の基本方針	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。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.08%
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社

## 先進国株式(除く日本)…為替ヘッジなし

ファンド名	外国株式インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>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。</li> </ul>
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社

## 新興国株式…為替ヘッジなし

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

## ▶ リート

## 国内リート

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

## 外国リート…為替ヘッジなし

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

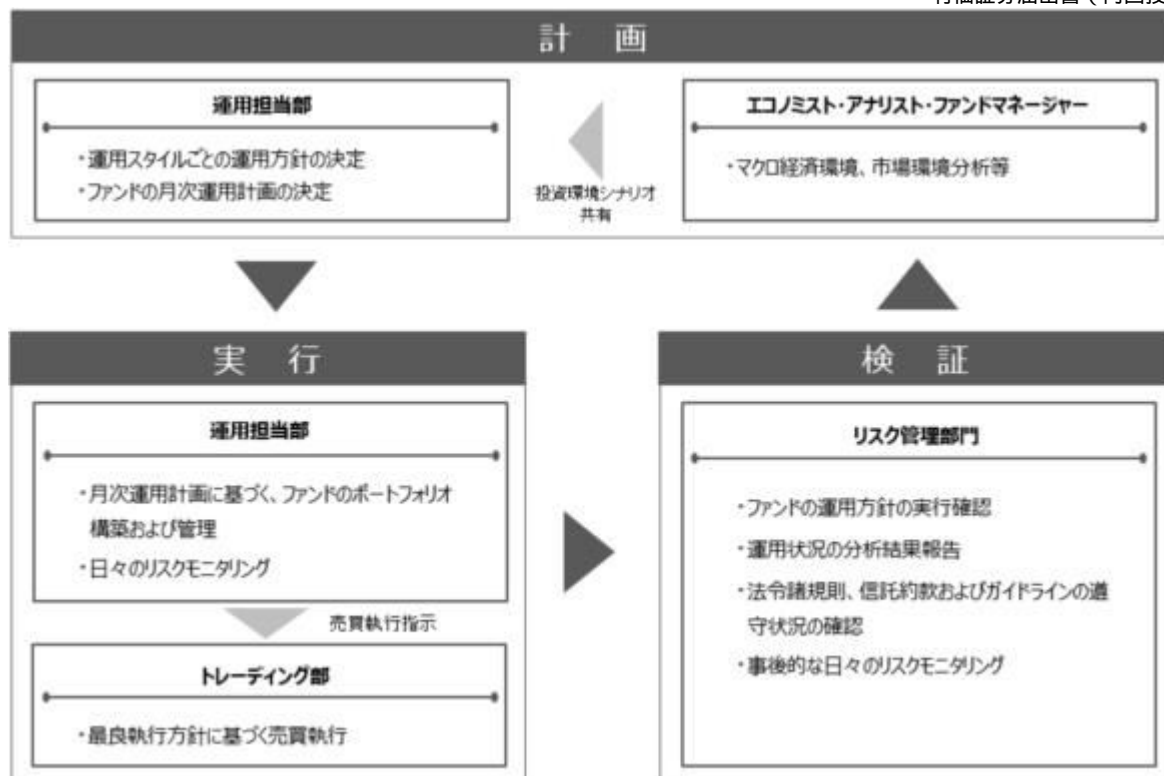

 指数の著作権など

- NOMURA-BPI(総合)は野村證券株式会社、FTSE世界国債インデックスはFTSE Fixed Income LLC、ブルームバーグ米ドル建て新興市場政府債RIC基準インデックスおよびブルームバーグ・ハイ・イールド・ベリー・リキッド・インデックスはBloomberg、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスはJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシー、TOPIX(東証株価指数)および東証REIT指数は株式会社JPX総研、MSCIコクサイインデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスはMSCI Inc.、S&P先進国REIT指数はS&P ダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが、それぞれ公表している指数です。
- 各インデックスに関する知的所有権その他一切の権利は、指数を公表する各社に帰属します。また、当該各社は当ファンドの運用に関して責任を負うものではありません。

※上記は、2023年1月24日現在における投資対象とする投資信託であり、今後変更となる場合があります。

## (3) 【運用体制】

## イ ファンドの運用体制



リスク管理部門の人員数は、約50名です。

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

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

□ 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】

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

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

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

（５）【投資制限】

## ファンドの信託約款に基づく投資制限

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

## 法令に基づく投資制限

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

## 八 信用リスク集中回避のための投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号の2）

委託会社は、運用財産に関し、信用リスク（保有する有価証券その他の資産について取引の相手方の債務不履行その他の理由により発生し得る危険をいいます。）を適正に管理する方法としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法に反することとなる取引を行うことを受託会社に指図しないものとします。

### 3【投資リスク】

#### イ ファンドのもつリスクの特性

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

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

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

当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

##### （イ）株式市場リスク

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

##### （ロ）債券市場リスク

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

##### （ハ）不動産投資信託（リート）に関するリスク

リートの価格は、不動産市況や金利・景気動向、関連法制度（税制、建築規制、会計制度等）の変更等の影響を受け変動します。また、リートに組み入れられている個々の不動産等の市場価値、賃貸収入等がマーケット要因によって上下するほか、自然災害等により個々の不動産等の毀損・滅失が生じる可能性もあります。さらに個々のリートは一般の法人と同様、運営如何によっては倒産の可能性もあります。これらの影響により、ファンドが組み入れているリートの価格が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

##### （ニ）信用リスク

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

##### （ホ）為替変動リスク

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

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

##### （ヘ）カントリーリスク

海外に投資を行う場合には、投資する有価証券の発行者に起因するリスクのほか、投資先の国の政治・経済・社会状況の不安定化や混乱などによって投資した資金の回収が困難になること



や、その影響により投資する有価証券の価格が大きく変動することがあり、基準価額が下落する要因となります。特に投資先が新興国の場合、その証券市場は先進国の証券市場に比べ、より運用上の制約が大きいことが想定されます。また、先進国に比べ、一般に市場規模が小さいため、有価証券の需給変動の影響を受けやすく、価格形成が偏ったり、変動性が大きくなる傾向が考えられます。

(ト) 市場流動性リスク

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

(チ) ファミリーファンド方式にかかる留意点

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

(リ) 換金制限等に関する留意点

ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性、換金申込みの受け付けが中止となる可能性、既に受け付けた換金申込みが取り消しとなる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性等があります。

(ヌ) 収益分配金に関する留意事項

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



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

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

□ 投資リスクの管理体制

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

リスク管理担当部は、信託約款等に定める各種投資制限やリスク指標のモニタリングを実施し、制限に対する抵触等があった場合には運用部門に対処要請等を行い、結果をリスク管理会議へ報告します。

また、ファンドのパフォーマンスの分析・評価を行い、結果を運用評価会議等へ報告することで、運用方針等との整合性を維持するよう適切に管理しています。

さらに、流動性リスク管理について規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングやストレステストを実施するとともに、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。

#### ■安定型



### 「ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較」

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



#### ■安定成長型



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## 【 ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移 】



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

### ■成長型



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

## 【 ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較 】



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



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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## 各資産クラスの指数

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

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

## 4 【手数料等及び税金】

### (1) 【申込手数料】

原則として、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）に、1.1%（税抜き1.0%）を上限として、販売会社がそれぞれ別に定める申込手数料率を乗じて得た額となります。申込手数料は販売会社によるファンドの募集・販売の取扱い事務等の対価です。

累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は無手数料となります。



申込手数料に関する詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

(2) 【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

(3) 【信託報酬等】

ファンド	純資産総額に年1.023%（税抜き0.93%）の率を乗じて得た金額が、毎日信託財産の費用として計上され、ファンドの基準価額に反映されます。また、信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。信託報酬の配分は以下の通りです。 < 信託報酬の配分（税抜き） >		
	支払先	料率	役務の内容
	委託会社	年0.47%	ファンドの運用およびそれに伴う調査、受託会社への指図、基準価額の算出、法定書面等の作成等の対価
	販売会社	年0.43%	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
	受託会社	年0.03%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価
	上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。		
投資対象とする投資信託	各ETFの配分比率の変動幅を加味した場合、管理費用の概算値は以下の通りとなります。		
	安定型	年0.015%～年0.049% <sup>*</sup>	
	安定成長型	年0.030%～年0.072% <sup>*</sup>	
	成長型	年0.038%～年0.075% <sup>*</sup>	
	管理費用は年度によって異なります。		
実質的な負担	ファンドの純資産総額に対して		
	安定型	年1.038%（税抜き0.945%）～年1.072%（税抜き0.979%）程度 <sup>*</sup>	
	安定成長型	年1.053%（税抜き0.960%）～年1.095%（税抜き1.002%）程度 <sup>*</sup>	
	成長型	年1.061%（税抜き0.968%）～年1.098%（税抜き1.005%）程度 <sup>*</sup>	
	上記は直近の基本資産配分および管理費用を用いた試算の結果であり、基本資産配分の見直しおよび実際の組入れ状況等により変動します。		

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

(4) 【その他の手数料等】

イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、原則として、計算期間を通じて毎日、純資産総額に

年0.0066% (税抜き0.006%) 以内の率を乗じて得た金額が信託財産の費用として計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となることがあります。2023年4月以降の決算等にかかる財務諸表の監査を行う監査法人を、PWCあらた有限責任監査法人に変更します。

- 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。
- 八 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□、八にかかる費用に関しましては、その時々取引内容等により金額が決定し、実務上、その発生もしくは請求のつど、信託財産の費用として認識され、その時点の信託財産で負担することとなります。したがって、あらかじめ、その金額、上限額、計算方法等を具体的に記載することはできません。

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

#### (5)【課税上の取扱い】

##### イ 個別元本について

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

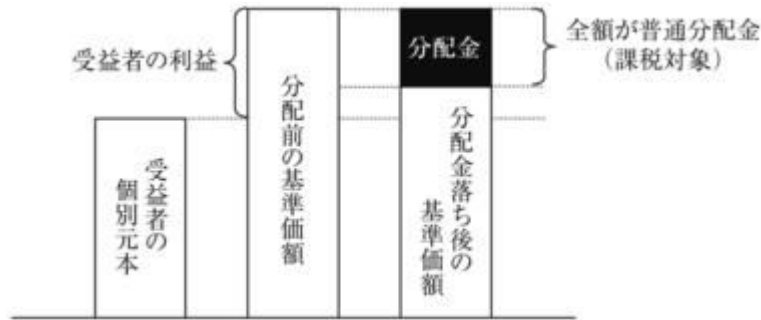
##### ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

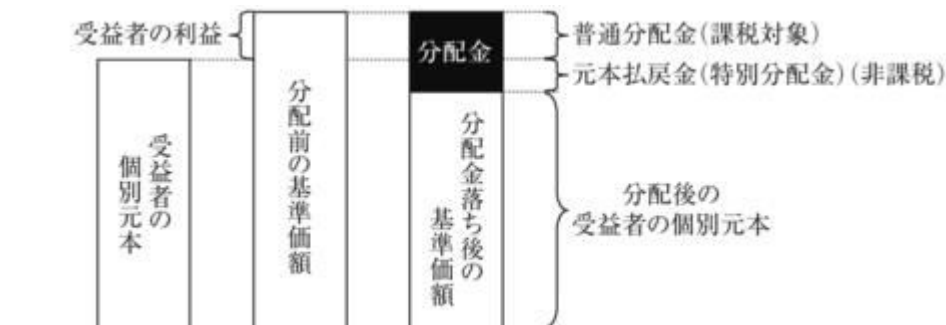
##### ハ 収益分配金の課税について

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

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



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



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

## 二 個人、法人別の課税の取扱いについて

### (イ) 個人の受益者に対する課税

#### ・収益分配時

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

#### ・一部解約時および償還時

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

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

### (ロ) 法人の受益者に対する課税

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

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

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。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	18歳以上の日本居住者 (専用口座が開設される年の1月1日現在)	0～17歳の日本居住者 (専用口座が開設される年の1月1日現在)
非課税の期間	最長5年間(新規の購入は2023年まで)*	
利用できる限度額	120万円/年 (最大600万円)	80万円/年 (最大400万円)

\*2024年以降、ジュニアNISAで新規の購入ができなくなります。  
なお、今後NISA制度は見直しされる予定です。

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11月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

## 5【運用状況】

### (1)【投資状況】

#### アセットアロケーション・ファンド(安定型)

2022年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	676,491,880	8.13
親投資信託受益証券	日本	7,485,780,695	90.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	155,408,796	1.87
合計(純資産総額)		8,317,681,371	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。以下同じ。  
その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	売建	-	679,603,306	8.17

#### アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)

2022年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
-------	------	-------------	-------------

投資証券	アメリカ	762,432,720	10.77
親投資信託受益証券	日本	6,162,644,914	87.06
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	153,570,720	2.17
合計（純資産総額）		7,078,648,354	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率 （％）
為替予約取引	売建	-	950,779,844	13.43

## アセットアロケーション・ファンド（成長型）

2022年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
投資証券	アメリカ	489,095,923	13.22
親投資信託受益証券	日本	3,126,698,765	84.49
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	85,039,788	2.29
合計（純資産総額）		3,700,834,476	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率 （％）
為替予約取引	売建	-	633,622,402	17.12

## （２）【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

## アセットアロケーション・ファンド（安定型）

### イ 主要投資銘柄

2022年11月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 （円）	帳簿価額 （円）	評価額 単価 （円）	評価額 （円）	投資 比率 （％）
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	2,635,970,847	1.3676	3,605,010,056	1.2767	3,365,343,980	40.46
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	1,428,963,488	1.2549	1,793,267,427	1.2284	1,755,338,748	21.10
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）	179,974,667	3.2709	588,687,237	3.4074	613,245,680	7.37
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	90,349,697	6.0417	545,868,369	6.1258	553,464,173	6.65

アメリカ	投資証券	S P D R ブルームバーク・ハイ・イールド債券E T F	32,035	13,339.35	427,326,218	12,694.11	406,655,708	4.89
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	180,504,559	2.0021	361,393,600	1.9980	360,648,108	4.34
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	123,734,117	2.6900	332,844,820	2.6996	334,032,622	4.02
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	183,852,090	1.6700	307,030,317	1.6483	303,043,399	3.64
アメリカ	投資証券	バンガード・米ドル建て新興国政府債券E T F	31,518	8,401.88	264,810,326	8,561.34	269,836,172	3.24
日本	親投資信託受益証券	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド	176,545,209	0.9346	165,000,000	0.9308	164,328,280	1.98
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	12,940,527	3.2211	41,682,732	2.8079	36,335,705	0.44

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11月30日現在

種類	投資比率 (%)
投資証券	8.13
親投資信託受益証券	90.00
合計	98.13

#### アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

##### イ 主要投資銘柄

2022年11月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額単価 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	1,354,062,532	1.3625	1,844,911,673	1.2767	1,728,731,634	24.42
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	748,629,323	1.2551	939,614,516	1.2284	919,616,260	12.99
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）	253,617,658	3.2355	820,572,902	3.4074	864,176,807	12.21
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	117,821,294	6.0593	713,909,611	6.1258	721,749,682	10.20

日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	226,924,020	2.6876	609,882,926	2.6996	612,604,084	8.65
アメリカ	投資証券	SPDR ブルームバーグ・ハイ・イールド債券ETF	42,006	13,342.90	560,481,984	12,694.11	533,228,646	7.53
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	291,047,771	1.6620	483,722,713	1.6483	479,734,040	6.78
日本	親投資信託受益証券	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド	425,820,622	0.9347	398,000,000	0.9308	396,353,834	5.60
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	196,065,249	2.0008	392,286,610	1.9980	391,738,367	5.53
アメリカ	投資証券	バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF	26,772	8,412.59	225,221,804	8,561.34	229,204,074	3.24
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	17,073,331	3.1013	52,949,653	2.8079	47,940,206	0.68

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11月30日現在

種類	投資比率 (%)
投資証券	10.77
親投資信託受益証券	87.06
合計	97.83

#### アセットアロケーション・ファンド（成長型）

##### イ 主要投資銘柄

2022年11月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額単価 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド (B号)	167,938,880	3.2358	543,423,998	3.4074	572,234,939	15.46
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	407,931,533	1.3579	553,939,707	1.2767	520,806,188	14.07
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	75,689,448	6.0572	458,467,761	6.1258	463,658,420	12.53
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	145,809,464	2.6807	390,871,099	2.6996	393,627,229	10.64

アメリカ	投資証券	S P D R ブルー ムバーク・ハイ・ イールド債券E T F	27,354	13,336.73	364,812,999	12,694.11	347,234,594	9.38
日本	親投資信 託受益証 券	エマージング株式 インデックス・マ ザーファンド	194,328,149	1.6612	322,816,612	1.6483	320,311,087	8.66
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	236,741,134	1.2553	297,174,316	1.2284	290,812,809	7.86
日本	親投資信 託受益証 券	米ドル建て新興国 債インデックス・ マザーファンド	296,532,241	0.9345	277,107,785	0.9308	276,012,209	7.46
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	127,100,213	2.0004	254,252,037	1.9980	253,946,225	6.86
アメリカ	投資証券	バンガード・米ド ル建て新興国政府 債券E T F	16,570	8,404.50	139,262,613	8,561.34	141,861,329	3.83
日本	親投資信 託受益証 券	外国リート・イン デックス・マザー ファンド	12,567,990	3.0945	38,892,174	2.8079	35,289,659	0.95

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

#### □ 種類別投資比率

2022年11月30日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	13.22
親投資信託受益証券	84.49
合計	97.70

#### 【投資不動産物件】

アセットアロケーション・ファンド(安定型)

該当事項はありません。

アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)

該当事項はありません。

アセットアロケーション・ファンド(成長型)

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

アセットアロケーション・ファンド(安定型)



種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	売建	4,907,000.00	699,057,476	679,603,306	8.17

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

#### アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)

2022年11月30日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	売建	6,865,000.00	982,333,223	950,779,844	13.43

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

#### アセットアロケーション・ファンド(成長型)

2022年11月30日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	売建	4,575,000.00	655,093,145	633,622,402	17.12

(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。

### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

#### アセットアロケーション・ファンド(安定型)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2016年 4月26日)	13,358,665,467	13,358,665,467	9,514	9,514
第2期 (2017年 4月26日)	48,551,937,727	48,551,937,727	9,992	9,992
第3期 (2018年 4月26日)	30,744,053,222	30,744,053,222	9,815	9,815
第4期 (2019年 4月26日)	21,753,606,702	21,753,606,702	10,029	10,029
第5期 (2020年 4月27日)	13,719,895,964	13,719,895,964	9,846	9,846
第6期 (2021年 4月26日)	11,087,292,976	11,087,292,976	10,684	10,684
第7期 (2022年 4月26日)	9,293,380,144	9,293,380,144	10,221	10,221
2021年11月末日	10,271,704,053	-	10,773	-
12月末日	10,144,320,214	-	10,888	-
2022年 1月末日	9,747,301,347	-	10,558	-

2月末日	9,545,388,741	-	10,368	-
3月末日	9,536,655,693	-	10,433	-
4月末日	9,293,208,485	-	10,221	-
5月末日	9,041,212,962	-	10,161	-
6月末日	8,727,078,620	-	9,894	-
7月末日	8,885,438,212	-	10,128	-
8月末日	8,740,807,284	-	9,980	-
9月末日	8,407,771,474	-	9,630	-
10月末日	8,426,052,555	-	9,717	-
11月末日	8,317,681,371	-	9,771	-

## アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2016年 4月26日)	12,391,100,166	12,391,100,166	9,296	9,296
第2期 (2017年 4月26日)	32,241,957,798	32,241,957,798	10,040	10,040
第3期 (2018年 4月26日)	20,024,628,165	20,024,628,165	10,020	10,020
第4期 (2019年 4月26日)	14,199,914,498	14,199,914,498	10,254	10,254
第5期 (2020年 4月27日)	9,390,219,478	9,390,219,478	9,662	9,662
第6期 (2021年 4月26日)	8,415,109,788	8,415,109,788	11,260	11,260
第7期 (2022年 4月26日)	7,383,568,948	7,383,568,948	10,932	10,932
2021年11月末日	7,963,172,323	-	11,391	-
12月末日	8,083,455,046	-	11,613	-
2022年 1月末日	7,716,962,777	-	11,167	-
2月末日	7,540,089,228	-	10,960	-
3月末日	7,579,436,667	-	11,201	-
4月末日	7,374,710,589	-	10,929	-
5月末日	7,273,964,240	-	10,896	-
6月末日	7,071,430,513	-	10,598	-
7月末日	7,229,839,449	-	10,869	-
8月末日	7,170,286,611	-	10,777	-
9月末日	6,901,767,206	-	10,337	-
10月末日	7,034,524,122	-	10,498	-
11月末日	7,078,648,354	-	10,582	-

## アセットアロケーション・ファンド(成長型)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2016年 4月26日)	12,509,183,920	12,509,183,920	9,159	9,159
第2期 (2017年 4月26日)	27,043,239,176	27,043,239,176	10,069	10,069
第3期 (2018年 4月26日)	14,776,735,458	14,776,735,458	10,111	10,111

第4期 (2019年 4月26日)	10,908,544,788	10,908,544,788	10,362	10,362
第5期 (2020年 4月27日)	5,612,179,736	5,612,179,736	9,482	9,482
第6期 (2021年 4月26日)	4,420,068,155	4,420,068,155	11,544	11,544
第7期 (2022年 4月26日)	3,876,188,991	3,876,188,991	11,299	11,299
2021年11月末日	4,188,706,826	-	11,708	-
12月末日	4,232,218,961	-	12,007	-
2022年 1月末日	4,049,955,659	-	11,477	-
2月末日	3,923,047,102	-	11,242	-
3月末日	4,016,647,104	-	11,593	-
4月末日	3,874,421,819	-	11,289	-
5月末日	3,847,126,250	-	11,275	-
6月末日	3,721,092,617	-	10,954	-
7月末日	3,801,145,097	-	11,248	-
8月末日	3,768,888,253	-	11,199	-
9月末日	3,591,015,136	-	10,711	-
10月末日	3,664,234,700	-	10,930	-
11月末日	3,700,834,476	-	11,023	-

## 【分配の推移】

## アセットアロケーション・ファンド(安定型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2015年 4月17日～2016年 4月26日	0
第2期	2016年 4月27日～2017年 4月26日	0
第3期	2017年 4月27日～2018年 4月26日	0
第4期	2018年 4月27日～2019年 4月26日	0
第5期	2019年 4月27日～2020年 4月27日	0
第6期	2020年 4月28日～2021年 4月26日	0
第7期	2021年 4月27日～2022年 4月26日	0

## アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2015年 4月17日～2016年 4月26日	0
第2期	2016年 4月27日～2017年 4月26日	0
第3期	2017年 4月27日～2018年 4月26日	0
第4期	2018年 4月27日～2019年 4月26日	0
第5期	2019年 4月27日～2020年 4月27日	0
第6期	2020年 4月28日～2021年 4月26日	0
第7期	2021年 4月27日～2022年 4月26日	0

## アセットアロケーション・ファンド(成長型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2015年 4月17日～2016年 4月26日	0
第2期	2016年 4月27日～2017年 4月26日	0
第3期	2017年 4月27日～2018年 4月26日	0
第4期	2018年 4月27日～2019年 4月26日	0
第5期	2019年 4月27日～2020年 4月27日	0
第6期	2020年 4月28日～2021年 4月26日	0
第7期	2021年 4月27日～2022年 4月26日	0

## 【収益率の推移】

## アセットアロケーション・ファンド(安定型)

	収益率(%)
第1期	4.9
第2期	5.0
第3期	1.8
第4期	2.2
第5期	1.8
第6期	8.5
第7期	4.3
第8期(中間期)	5.8

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

## アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)

	収益率(%)
第1期	7.0
第2期	8.0
第3期	0.2
第4期	2.3
第5期	5.8
第6期	16.5
第7期	2.9
第8期(中間期)	4.9

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

## アセットアロケーション・ファンド(成長型)

	収益率(%)
第1期	8.4
第2期	9.9
第3期	0.4

第4期	2.5
第5期	8.5
第6期	21.7
第7期	2.1
第8期(中間期)	4.2

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

#### (4) 【設定及び解約の実績】

##### アセットアロケーション・ファンド(安定型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	14,471,203,211	430,595,693
第2期	39,440,607,065	4,888,096,644
第3期	3,005,688,776	20,274,975,700
第4期	913,665,451	10,547,332,018
第5期	258,180,741	8,014,561,766
第6期	246,744,303	3,802,926,621
第7期	158,442,458	1,443,373,995
第8期(中間期)	117,038,565	536,060,424

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

##### アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	13,473,777,867	144,788,717
第2期	22,569,690,166	3,786,328,653
第3期	1,994,684,295	14,122,473,521
第4期	758,923,595	6,895,231,238
第5期	498,733,066	4,628,274,076
第6期	582,836,155	2,828,418,770
第7期	430,295,633	1,149,383,746
第8期(中間期)	209,590,414	262,846,739

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

##### アセットアロケーション・ファンド(成長型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	13,883,023,089	225,050,831
第2期	19,324,709,567	6,124,106,042
第3期	2,148,349,345	14,391,885,041
第4期	1,008,692,045	5,095,880,106
第5期	306,069,242	4,915,238,211
第6期	188,201,809	2,277,873,843

第7期	172,858,285	571,200,442
第8期(中間期)	85,115,571	161,992,070

(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11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	218,143,627,430	97.90
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	4,675,713,177	2.10
合計(純資産総額)		222,819,340,607	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	4,557,100,000	2.05
合計	買建	-	4,557,100,000	2.05

外国株式インデックス・マザーファンド

2022年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	288,519,854,007	65.25
	イギリス	18,351,647,178	4.15
	カナダ	16,072,908,172	3.63
	スイス	14,076,027,535	3.18
	フランス	13,523,070,822	3.06
	ドイツ	10,114,853,576	2.29
	オーストラリア	9,009,355,431	2.04
	オランダ	7,850,179,472	1.78
	アイルランド	7,553,931,219	1.71
	スウェーデン	4,054,266,106	0.92
	デンマーク	3,488,710,185	0.79
	スペイン	3,082,692,257	0.70
	香港	2,515,683,999	0.57
	イタリア	2,253,838,969	0.51
	ジャージー	1,663,184,736	0.38
	フィンランド	1,564,344,000	0.35
	シンガポール	1,460,996,313	0.33
	ベルギー	1,029,608,359	0.23
	ノルウェー	994,397,517	0.22
	イスラエル	959,733,265	0.22
ケイマン諸島	837,666,705	0.19	
バミューダ	681,478,096	0.15	

	オランダ領キュラソー	634,174,539	0.14
	ルクセンブルグ	312,951,301	0.07
	ニュージーランド	285,261,247	0.06
	オーストリア	239,889,693	0.05
	ポルトガル	220,324,207	0.05
	リベリア	133,966,946	0.03
	マン島	97,935,742	0.02
	パナマ	94,433,509	0.02
	小計	411,677,365,103	93.10
投資証券	アメリカ	8,391,121,907	1.90
	オーストラリア	884,040,045	0.20
	香港	192,862,149	0.04
	イギリス	180,024,185	0.04
	シンガポール	178,360,484	0.04
	フランス	157,176,856	0.04
	カナダ	52,309,094	0.01
	ベルギー	36,607,495	0.01
	小計	10,072,502,215	2.28
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	20,451,694,134	4.62
合計（純資産総額）		442,201,561,452	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	963,434,171	0.22
株価指数先物取引	買建	ドイツ	3,089,695,148	0.70
株価指数先物取引	買建	アメリカ	15,983,395,407	3.61
株価指数先物取引	買建	オーストラリア	757,862,325	0.17
合計	買建	-	20,794,387,051	4.70

種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建	-	2,641,714,660	0.60
為替予約取引	売建	-	467,278,559	0.11

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2022年11月30日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	ケイマン諸島	3,585,329,955	13.50
	インド	3,217,386,133	12.12
	台湾	3,026,730,230	11.40
	韓国	2,547,941,234	9.60
	中国	1,456,516,893	5.49
	ブラジル	1,105,985,453	4.17
	南アフリカ	783,118,405	2.95

	タイ	461,291,238	1.74
	インドネシア	433,771,072	1.63
	メキシコ	408,911,583	1.54
	マレーシア	326,235,893	1.23
	香港	257,887,645	0.97
	フィリピン	167,795,779	0.63
	ポーランド	134,030,586	0.50
	チリ	119,894,241	0.45
	バミューダ	111,508,648	0.42
	トルコ	108,613,704	0.41
	アメリカ	94,353,825	0.36
	ギリシャ	62,141,172	0.23
	コロンビア	32,032,827	0.12
	ハンガリー	30,561,582	0.12
	チェコ	29,253,799	0.11
	エジプト	14,940,119	0.06
	ルクセンブルグ	14,722,598	0.06
	オランダ	9,316,885	0.04
	シンガポール	6,328,524	0.02
	ペルー	4,525,034	0.02
	小計	18,551,125,057	69.87
投資信託受益証券	香港	1,080,935,590	4.07
投資証券	アメリカ	1,595,785,149	6.01
	メキシコ	108,011,630	0.41
	ブラジル	39,441,635	0.15
	南アフリカ	8,308,225	0.03
	小計	1,751,546,639	6.60
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	5,167,003,135	19.46
合計（純資産総額）		26,550,610,421	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	5,271,112,197	19.85
合計	買建	-	5,271,112,197	19.85

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	-	262,124,442	0.99

Jリート・インデックス・マザーファンド

2022年11月30日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	10,443,009,900	98.85
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	121,145,886	1.15
合計（純資産総額）		10,564,155,786	100.00

その他以下の取引を行っております。



種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
リート指数先物取引	買建	日本	39,400,000	0.37
合計	買建	-	39,400,000	0.37

## 外国リート・インデックス・マザーファンド

2022年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	19,072,541,909	76.66
	オーストラリア	1,643,027,669	6.60
	イギリス	1,148,183,767	4.61
	シンガポール	880,858,663	3.54
	カナダ	462,565,361	1.86
	フランス	420,124,727	1.69
	香港	328,750,955	1.32
	ベルギー	242,630,922	0.98
	スペイン	105,545,172	0.42
	ニュージーランド	92,942,015	0.37
	韓国	55,212,727	0.22
	オランダ	46,961,114	0.19
	イスラエル	36,614,554	0.15
	ガーンジィ	28,181,183	0.11
	ドイツ	11,520,234	0.05
	アイルランド	8,735,820	0.04
イタリア	2,242,359	0.01	
小計		24,586,639,151	98.82
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	292,990,737	1.18
合計(純資産総額)		24,879,629,888	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	-	148,330,622	0.60

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

2022年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	102,331,813,330	79.34
地方債証券	日本	9,907,950,900	7.68
特殊債券	日本	9,121,374,577	7.07
社債券	日本	6,590,447,400	5.11
	フランス	199,950,600	0.16
	小計	6,790,398,000	5.26
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	833,330,197	0.65
合計(純資産総額)		128,984,867,004	100.00

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

2022年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	76,563,574,423	49.65
	フランス	13,205,547,994	8.56
	イタリア	11,692,881,479	7.58
	ドイツ	10,203,936,907	6.62
	スペイン	7,832,490,729	5.08
	イギリス	7,234,288,541	4.69
	中国	5,037,419,254	3.27
	カナダ	3,148,510,312	2.04
	ベルギー	2,880,108,479	1.87
	オランダ	2,439,756,731	1.58
	オーストラリア	2,357,407,800	1.53
	オーストリア	1,778,682,751	1.15
	メキシコ	1,291,724,775	0.84
	アイルランド	967,634,580	0.63
	マレーシア	798,165,826	0.52
	フィンランド	759,505,033	0.49
	シンガポール	695,998,075	0.45
	ポーランド	641,932,332	0.42
	デンマーク	565,968,202	0.37
	イスラエル	565,610,256	0.37
スウェーデン	393,641,510	0.26	
ニュージーランド	317,273,721	0.21	
ノルウェー	306,948,334	0.20	
小計		151,679,008,044	98.36
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	2,530,522,236	1.64
合計（純資産総額）		154,209,530,280	100.00

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2022年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	11,470,848,071	47.45
	フランス	1,950,989,089	8.07
	イタリア	1,742,194,522	7.21
	ドイツ	1,517,344,552	6.28
	スペイン	1,191,332,436	4.93
	イギリス	1,084,951,027	4.49
	中国	753,604,424	3.12
	カナダ	469,414,840	1.94
	ベルギー	433,804,435	1.79

	オランダ	371,078,417	1.54
	オーストラリア	353,685,508	1.46
	オーストリア	276,473,512	1.14
	シンガポール	224,662,763	0.93
	メキシコ	194,622,001	0.81
	アイルランド	156,771,096	0.65
	フィンランド	119,781,026	0.50
	ポーランド	97,202,997	0.40
	デンマーク	85,810,610	0.35
	イスラエル	84,094,954	0.35
	スウェーデン	58,040,879	0.24
	ノルウェー	47,803,993	0.20
	ニュージーランド	47,621,862	0.20
	小計	22,732,133,014	94.04
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	1,440,697,137	5.96
合計（純資産総額）		24,172,830,151	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率 （％）
為替予約取引	売建	-	22,407,884,909	92.70

米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

2022年11月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
国債証券	カタール	289,588,943	9.58
	メキシコ	277,992,604	9.20
	アラブ首長国連邦	268,211,851	8.87
	サウジアラビア	265,205,038	8.77
	チリ	206,980,735	6.85
	オマーン	194,149,147	6.42
	ドミニカ共和国	186,183,564	6.16
	ブラジル	183,248,130	6.06
	トルコ	152,391,494	5.04
	パナマ	143,838,213	4.76
	中国	135,267,434	4.47
	南アフリカ	134,896,096	4.46
	インドネシア	127,283,520	4.21
	ペルー	121,219,345	4.01
	ウルグアイ	82,177,988	2.72
	フィリピン	65,096,145	2.15
コロンビア	60,958,375	2.02	
小計		2,894,688,622	95.75
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	128,421,081	4.25

合計(純資産総額)	3,023,109,703	100.00
-----------	---------------	--------

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	買建	-	9,719,591	0.32

## (2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2022年11月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	4,175,600	2,009.93	8,392,645,451	2,010.50	8,395,043,800	3.77
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	537,900	13,514.78	7,269,601,680	11,255.00	6,054,064,500	2.72
日本	株式	キーエンス	電気機器	76,100	67,945.08	5,170,620,214	57,140.00	4,348,354,000	1.95
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	977,200	3,291.09	3,216,053,485	3,820.00	3,732,904,000	1.68
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	4,906,500	609.84	2,992,202,725	755.10	3,704,898,150	1.66
日本	株式	第一三共	医薬品	664,400	2,964.15	1,969,381,698	4,518.00	3,001,759,200	1.35
日本	株式	任天堂	その他製品	480,200	5,124.99	2,461,019,550	5,894.00	2,830,298,800	1.27
日本	株式	日立製作所	電気機器	385,500	6,649.33	2,563,316,909	7,299.00	2,813,764,500	1.26
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	675,000	3,119.99	2,105,993,550	4,050.00	2,733,750,000	1.23
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	441,100	5,913.54	2,608,461,564	5,952.00	2,625,427,200	1.18
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	546,500	3,733.95	2,040,604,100	4,673.00	2,553,794,500	1.15
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	578,700	6,764.45	3,914,587,706	4,329.00	2,505,192,300	1.12
日本	株式	KDDI	情報・通信業	589,400	3,427.40	2,020,112,299	4,111.00	2,423,023,400	1.09
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	53,600	58,753.97	3,149,212,752	45,090.00	2,416,824,000	1.08
日本	株式	三井物産	卸売業	588,600	2,590.26	1,524,624,639	3,983.00	2,344,393,800	1.05
日本	株式	三菱商事	卸売業	502,500	3,435.82	1,726,500,100	4,605.00	2,314,012,500	1.04
日本	株式	HOYA	精密機器	164,300	17,417.64	2,861,718,466	14,060.00	2,310,058,000	1.04
日本	株式	信越化学工業	化学	130,300	18,911.26	2,464,136,737	17,570.00	2,289,371,000	1.03
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	753,500	1,985.67	1,496,199,058	2,827.00	2,130,144,500	0.96
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	495,400	3,294.38	1,632,038,169	4,287.00	2,123,779,800	0.95
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	618,000	3,118.23	1,927,067,204	3,356.00	2,074,008,000	0.93
日本	株式	ダイキン工業	機械	91,700	23,176.98	2,125,329,325	22,405.00	2,054,538,500	0.92
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,081,300	1,425.90	1,541,824,530	1,717.00	1,856,592,100	0.83

日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,225,300	1,552.63	1,902,442,539	1,497.50	1,834,886,750	0.82
日本	株式	村田製作所	電気機器	230,500	8,360.82	1,927,168,168	7,464.00	1,720,452,000	0.77
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	82,800	17,981.96	1,488,906,144	19,720.00	1,632,816,000	0.73
日本	株式	日本電産	電気機器	186,600	12,797.13	2,387,943,848	8,534.00	1,592,444,400	0.71
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	730,900	1,810.80	1,323,515,954	2,128.00	1,555,355,200	0.70
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	277,300	4,613.21	1,279,242,516	5,579.00	1,547,056,700	0.69
日本	株式	S M C	機械	24,900	71,588.65	1,782,557,301	61,760.00	1,537,824,000	0.69

□ 種類別・業種別投資比率

2022年11月30日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式(国内)	水産・農林業	0.09
	鉱業	0.32
	建設業	1.90
	食料品	3.42
	繊維製品	0.44
	パルプ・紙	0.17
	化学	6.01
	医薬品	5.64
	石油・石炭製品	0.48
	ゴム製品	0.73
	ガラス・土石製品	0.69
	鉄鋼	0.74
	非鉄金属	0.71
	金属製品	0.55
	機械	5.06
	電気機器	17.08
	輸送用機器	7.58
	精密機器	2.69
	その他製品	2.32
	電気・ガス業	1.17
	陸運業	3.12
	海運業	0.58
	空運業	0.50
	倉庫・運輸関連業	0.14
	情報・通信業	8.64
	卸売業	5.81
	小売業	4.40
	銀行業	5.45
	証券、商品先物取引業	0.72
	保険業	2.31
その他金融業	1.09	
不動産業	2.07	

	サービス業	5.28
合計		97.90

## 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11月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,024,949	22,161.83	22,714,741,883	19,604.28	20,093,385,029	4.54
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	450,054	45,275.15	20,376,264,591	33,374.63	15,020,384,424	3.40
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	580,471	23,522.77	13,654,287,873	12,834.37	7,449,976,918	1.68
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CLASS A	メディア・エンターテインメント	380,693	19,556.34	7,444,961,062	13,219.04	5,032,394,205	1.14
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CLASS C	メディア・エンターテインメント	356,993	19,690.48	7,029,362,855	13,253.75	4,731,496,973	1.07
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	59,375	64,258.35	3,815,339,823	73,323.36	4,353,574,500	0.98
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	167,195	49,576.00	8,288,859,295	25,111.86	4,198,577,783	0.95
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	267,258	9,305.06	2,486,850,745	15,350.69	4,102,594,654	0.93
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	166,536	22,521.55	3,750,648,809	24,453.62	4,072,407,777	0.92
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CLASS B	各種金融	81,417	39,765.80	3,237,612,299	43,762.10	3,562,979,148	0.81
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	186,539	21,579.59	4,025,435,757	18,964.09	3,537,541,862	0.80
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	158,898	42,950.40	6,824,732,199	21,717.88	3,450,927,585	0.78
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	151,847	20,622.50	3,131,465,090	20,202.81	3,067,735,725	0.69
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	104,154	27,637.63	2,878,569,826	29,032.16	3,023,815,821	0.68

アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	118,131	17,132.38	2,023,864,708	25,139.64	2,969,770,352	0.67
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	178,946	17,378.19	3,109,756,970	16,207.24	2,900,221,520	0.66
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	65,045	54,109.88	3,519,577,402	43,877.37	2,854,003,219	0.65
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	ソフトウェア・サービス	54,961	45,444.38	2,497,668,548	47,650.46	2,618,917,102	0.59
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	51,114	36,773.70	1,879,650,774	50,541.74	2,583,390,319	0.58
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	112,430	16,994.98	1,910,745,292	21,969.23	2,470,000,978	0.56
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	356,455	7,244.92	2,582,487,054	6,872.68	2,449,799,830	0.55
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	160,911	10,767.06	1,732,537,958	15,114.61	2,432,107,138	0.55
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	458,912	6,134.47	2,815,183,627	5,138.19	2,357,977,049	0.53
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	262,091	7,768.10	2,035,949,160	8,676.60	2,274,058,141	0.51
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	87,989	22,954.78	2,019,767,883	25,356.27	2,231,073,131	0.50
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	145,152	43,902.10	6,372,477,880	15,200.71	2,206,413,486	0.50
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	25,752	97,290.92	2,505,435,900	80,376.08	2,069,844,915	0.47
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	食品・生活必需品小売り	28,136	75,985.84	2,137,937,688	73,456.68	2,066,777,013	0.47
アメリカ	株式	WALMART INC	食品・生活必需品小売り	96,431	19,638.25	1,893,735,787	21,242.94	2,048,478,323	0.46

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	44,508	51,523.59	2,293,212,053	45,048.45	2,005,016,301	0.45
-----	----	---------------------------------	--	--------	-----------	---------------	-----------	---------------	------

□ 種類別・業種別投資比率

2022年11月30日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式(外国)	エネルギー	5.74
	素材	4.23
	資本財	6.32
	商業・専門サービス	1.18
	運輸	1.81
	自動車・自動車部品	1.81
	耐久消費財・アパレル	1.50
	消費者サービス	1.85
	小売	4.27
	食品・生活必需品小売り	1.57
	食品・飲料・タバコ	4.24
	家庭用品・パーソナル用品	1.71
	ヘルスケア機器・サービス	4.79
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイ エンス	8.98
	銀行	5.87
	各種金融	4.64
	保険	3.23
	不動産	0.32
	ソフトウェア・サービス	9.88
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.96
半導体・半導体製造装置	4.14	
電気通信サービス	1.38	
公益事業	3.01	
メディア・娯楽	4.67	
投資証券	-	2.28
合計		95.38

エマージング株式インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2022年11月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・ 半導体製 造装置	608,000	2,594.22	1,577,286,725	2,186.73	1,329,530,259	5.01



香港	投資信託受益証券	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	-	1,403,800	911.5388	1,279,618,147	770.0068	1,080,935,590	4.07
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	-	166,080	5,807.18	964,455,948	5,439.54	903,398,454	3.40
ケイマン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	154,200	7,378.78	1,137,807,553	5,081.52	783,571,000	2.95
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	117,729	7,319.34	861,698,772	6,350.88	747,682,751	2.82
ケイマン諸島	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	小売	374,600	2,118.53	793,599,764	1,400.18	524,505,555	1.98
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	75,244	4,263.54	320,806,067	4,637.86	348,971,288	1.31
ケイマン諸島	株式	MEITUAN-CLASS B	小売	108,900	3,957.27	430,946,503	2,763.01	300,892,006	1.13
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI UAE ETF	-	130,807	2,305.39	301,561,725	2,124.71	277,927,071	1.05
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	83,406	2,813.12	234,631,497	2,785.68	232,342,050	0.88
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI QATAR ETF	-	82,108	2,959.49	242,997,829	2,828.78	232,265,624	0.87
ブラジル	株式	VALE SA	素材	98,688	1,914.94	188,981,240	2,218.40	218,929,383	0.82
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	127,560	1,278.88	163,134,028	1,618.94	206,512,305	0.78
ケイマン諸島	株式	JD.COM INC - CLASS A	小売	53,435	5,375.33	287,230,863	3,748.02	200,275,662	0.75
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	2,379,000	92.14	219,208,728	83.92	199,649,486	0.75
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	各種金融	42,746	4,454.57	190,414,839	4,557.58	194,818,207	0.73
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI KUWAIT ETF	-	37,235	4,938.74	183,893,860	4,893.08	182,193,998	0.69
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	307,800	473.45	145,727,555	449.02	138,208,356	0.52
ケイマン諸島	株式	PINDUODUO INC-ADR	小売	12,466	9,409.34	117,296,773	10,891.57	135,774,362	0.51
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	157,500	956.78	150,692,532	840.11	132,316,537	0.50
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	22,550	5,907.51	133,214,281	5,809.47	131,003,514	0.49

台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	37,000	4,301.66	159,161,326	3,201.51	118,455,966	0.45
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	13,459	11,795.23	158,751,987	8,771.76	118,059,117	0.44
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	20,285	6,651.89	134,933,582	5,764.00	116,922,740	0.44
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	1,382,000	67.56	93,366,708	79.88	110,390,705	0.42
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	5,394	19,159.88	103,348,369	20,273.60	109,355,807	0.41
韓国	株式	SAMSUNG SDI CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,371	69,733.92	95,605,206	75,246.40	103,162,814	0.39
ケイマン諸島	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	51,100	2,997.51	153,172,986	1,950.47	99,668,812	0.38
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	1,981,000	49.76	98,565,406	49.07	97,213,216	0.37
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	1,406,000	75.17	105,687,169	68.99	96,994,878	0.37

□ 種類別・業種別投資比率

2022年11月30日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式(外国)	エネルギー	3.65
	素材	5.93
	資本財	2.48
	商業・専門サービス	0.05
	運輸	1.51
	自動車・自動車部品	2.40
	耐久消費財・アパレル	1.14
	消費者サービス	0.97
	小売	5.71
	食品・生活必需品小売り	1.10
	食品・飲料・タバコ	2.30
	家庭用品・パーソナル用品	0.74
	ヘルスケア機器・サービス	0.64
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.08
	銀行	9.23
	各種金融	2.37
	保険	2.05
不動産	1.27	

	ソフトウェア・サービス	2.12
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.31
	半導体・半導体製造装置	6.91
	電気通信サービス	1.94
	公益事業	2.13
	メディア・娯楽	4.84
投資信託受益証券	-	4.07
投資証券	-	6.60
合計		80.54

## Jリート・インデックス・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2022年11月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド 投資法人	1,107	682,138.19	755,126,979	640,000.00	708,480,000	6.71
日本	投資証券	ジャパンリアルエ ステイト投資法人	949	633,965.47	601,633,234	609,000.00	577,941,000	5.47
日本	投資証券	野村不動産マス ターファンド投資 法人	3,071	167,083.65	513,113,879	172,500.00	529,747,500	5.01
日本	投資証券	日本都市ファンド 投資法人	4,791	109,732.41	525,727,973	110,100.00	527,489,100	4.99
日本	投資証券	日本プロロジス リート投資法人	1,556	344,319.63	535,761,339	337,500.00	525,150,000	4.97
日本	投資証券	G L P 投資法人	3,065	168,622.08	516,826,664	154,000.00	472,010,000	4.47
日本	投資証券	大和ハウスリート 投資法人	1,431	320,070.26	458,020,549	307,500.00	440,032,500	4.17
日本	投資証券	オリックス不動産 投資法人	1,893	192,590.08	364,573,030	193,500.00	366,295,500	3.47
日本	投資証券	ユナイテッド・ アーバン投資法人	2,126	147,867.98	314,367,327	154,200.00	327,829,200	3.10
日本	投資証券	アドバンス・レジ デンス投資法人	950	357,697.66	339,812,776	344,000.00	326,800,000	3.09
日本	投資証券	日本プライムリア ルティ投資法人	650	401,425.87	260,926,818	393,000.00	255,450,000	2.42
日本	投資証券	積水ハウス・リー ト投資法人	2,872	83,473.98	239,737,280	80,500.00	231,196,000	2.19
日本	投資証券	ジャパン・ホテ ル・リート投資法 人	3,066	69,821.73	214,073,426	74,700.00	229,030,200	2.17
日本	投資証券	産業ファンド投資 法人	1,421	178,469.12	253,604,621	159,100.00	226,081,100	2.14
日本	投資証券	アクティブア・プ ロパティーズ投資 法人	501	426,707.07	213,780,244	427,000.00	213,927,000	2.03
日本	投資証券	日本アコモデー ションファンド投 資法人	328	673,308.06	220,845,043	627,000.00	205,656,000	1.95

日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	641	326,845.23	209,507,790	320,500.00	205,440,500	1.94
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	4,186	43,283.64	181,185,336	47,650.00	199,462,900	1.89
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	1,164	173,018.16	201,393,133	161,300.00	187,753,200	1.78
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	375	538,168.48	201,813,180	499,500.00	187,312,500	1.77
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	553	354,796.01	196,202,192	337,500.00	186,637,500	1.77
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	352	529,333.37	186,325,346	529,000.00	186,208,000	1.76
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	1,117	154,569.48	172,654,105	161,500.00	180,395,500	1.71
日本	投資証券	イオンリート投資法人	1,053	155,647.02	163,896,307	159,600.00	168,058,800	1.59
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	890	166,246.44	147,959,332	172,400.00	153,436,000	1.45
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	1,291	121,817.18	157,265,973	118,000.00	152,338,000	1.44
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	326	468,275.63	152,657,857	440,500.00	143,603,000	1.36
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	681	220,066.13	149,865,037	208,900.00	142,260,900	1.35
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	442	333,921.65	147,593,371	315,500.00	139,451,000	1.32
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	638	197,287.61	125,869,493	215,600.00	137,552,800	1.30

## ロ 種類別投資比率

2022年11月30日現在

種類	投資比率（％）
投資証券	98.85
合計	98.85

## 外国リート・インデックス・マザーファンド

### イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2022年11月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価（円）	帳簿価額（円）	評価額単価（円）	評価額（円）	投資比率（％）
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	127,900	18,011.04	2,303,611,556	15,804.79	2,021,433,242	8.12
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	12,620	92,573.71	1,168,280,214	93,176.22	1,175,883,835	4.73
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	21,939	47,108.31	1,033,509,238	40,355.62	885,361,991	3.56
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	86,021	9,706.55	834,966,931	8,651.60	744,219,369	2.99
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	45,601	14,833.19	676,408,501	16,311.67	743,828,472	2.99

アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	133,286	4,702.19	626,736,382	4,675.75	623,212,401	2.50
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	64,600	10,637.36	687,173,198	9,609.80	620,793,338	2.50
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	39,776	17,270.20	686,939,373	15,102.11	600,701,626	2.41
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	19,520	28,754.65	561,290,824	23,717.61	462,967,694	1.86
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	20,661	21,969.26	453,906,788	21,180.45	437,609,327	1.76
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	47,128	10,565.16	497,914,959	8,829.35	416,109,823	1.67
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	236,100	1,785.57	421,573,686	1,734.25	409,455,268	1.65
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	18,533	28,513.42	528,439,183	21,319.32	395,111,002	1.59
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	16,150	24,323.11	392,818,175	22,485.83	363,146,160	1.46
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	81,180	5,200.65	422,188,975	4,432.73	359,849,053	1.45
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	56,111	6,621.28	371,526,796	6,304.70	353,762,909	1.42
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	17,270	21,964.06	379,319,277	20,109.76	347,295,636	1.40
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	29,170	11,864.44	346,085,796	10,862.41	316,856,540	1.27
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	40,229	7,515.64	302,346,821	7,479.54	300,894,342	1.21
香港	投資証券	LINK REIT	294,700	1,073.20	316,272,765	935.23	275,611,691	1.11
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	76,084	3,728.50	283,678,904	3,560.63	270,906,729	1.09
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	85,800	3,053.23	261,966,712	3,155.13	270,709,845	1.09
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	8,849	38,716.87	342,605,604	29,786.23	263,578,316	1.06
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	99,100	2,580.61	255,738,177	2,591.31	256,799,237	1.03
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	35,357	7,052.09	249,340,582	7,161.53	253,210,071	1.02
アメリカ	投資証券	UDR INC	42,269	6,502.66	274,860,862	5,658.95	239,198,263	0.96
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	14,475	18,860.89	273,011,386	16,351.94	236,694,367	0.95
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	167,300	1,599.28	267,559,820	1,343.80	224,818,295	0.90
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	23,766	10,100.06	240,037,983	9,086.26	215,944,152	0.87
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	734,000	264.34	194,026,800	272.80	200,237,108	0.80

□ 種類別投資比率

2022年11月30日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	98.82
合計	98.82

## 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11月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債 証券	3 6 7 1 0年国債	2,520,000,000	99.87	2,516,816,200	99.67	2,511,759,600	0.200	2032/06/20	1.95
日本	国債 証券	4 3 8 2 年国債	2,350,000,000	100.13	2,353,068,500	100.08	2,351,856,500	0.005	2024/07/01	1.82
日本	国債 証券	1 5 3 5 年国債	1,900,000,000	99.94	1,898,945,900	99.61	1,892,666,000	0.005	2027/06/20	1.47
日本	国債 証券	1 4 7 5 年国債	1,540,000,000	100.17	1,542,648,800	100.00	1,540,000,000	0.005	2026/03/20	1.19
日本	国債 証券	1 4 8 5 年国債	1,530,000,000	100.15	1,532,306,600	99.96	1,529,449,200	0.005	2026/06/20	1.19
日本	国債 証券	3 5 7 1 0年国債	1,410,000,000	99.73	1,406,181,500	99.20	1,398,734,100	0.100	2029/12/20	1.08
日本	国債 証券	3 6 3 1 0年国債	1,350,000,000	99.17	1,338,859,500	98.41	1,328,589,000	0.100	2031/06/20	1.03
日本	国債 証券	3 6 1 1 0年国債	1,260,000,000	99.38	1,252,158,900	98.62	1,242,624,600	0.100	2030/12/20	0.96
日本	国債 証券	1 4 9 5 年国債	1,240,000,000	100.15	1,241,872,400	99.91	1,238,822,000	0.005	2026/09/20	0.96
日本	国債 証券	1 5 0 5 年国債	1,230,000,000	100.13	1,231,642,400	99.82	1,227,761,400	0.005	2026/12/20	0.95
日本	国債 証券	1 4 5 5 年国債	1,180,000,000	100.49	1,185,778,800	100.31	1,183,634,400	0.100	2025/09/20	0.92
日本	国債 証券	1 5 4 5 年国債	1,100,000,000	99.96	1,099,588,400	99.95	1,099,472,000	0.100	2027/09/20	0.85
日本	国債 証券	3 6 2 1 0年国債	1,080,000,000	99.33	1,072,764,000	98.50	1,063,800,000	0.100	2031/03/20	0.82
日本	国債 証券	1 4 6 5 年国債	1,000,000,000	100.52	1,005,167,200	100.32	1,003,200,000	0.100	2025/12/20	0.78
日本	国債 証券	4 3 9 2 年国債	1,000,000,000	100.19	1,001,890,000	100.08	1,000,750,000	0.005	2024/08/01	0.78
日本	国債 証券	3 5 9 1 0年国債	1,000,000,000	99.51	995,133,000	98.89	988,880,000	0.100	2030/06/20	0.77
日本	国債 証券	1 4 4 5 年国債	980,000,000	100.48	984,664,800	100.29	982,871,400	0.100	2025/06/20	0.76
日本	国債 証券	3 5 8 1 0年国債	940,000,000	99.68	936,965,600	99.07	931,220,400	0.100	2030/03/20	0.72
日本	国債 証券	3 6 8 1 0年国債	920,000,000	99.52	915,584,000	99.52	915,593,200	0.200	2032/09/20	0.71
日本	国債 証券	3 6 0 1 0年国債	910,000,000	99.55	905,915,600	98.74	898,515,800	0.100	2030/09/20	0.70
日本	国債 証券	3 6 5 1 0年国債	890,000,000	99.06	881,634,000	98.41	875,849,000	0.100	2031/12/20	0.68
日本	国債 証券	3 4 4 1 0年国債	811,000,000	100.56	815,557,820	100.27	813,149,150	0.100	2026/09/20	0.63
日本	国債 証券	3 3 8 1 0年国債	805,000,000	101.30	815,440,850	100.95	812,679,700	0.400	2025/03/20	0.63

日本	国債証券	8 8 2 0 年国債	742,000,000	109.51	812,586,460	108.11	802,161,360	2.300	2026/06/20	0.62
日本	国債証券	1 4 1 5 年国債	795,000,000	100.38	798,044,850	100.24	796,931,850	0.100	2024/09/20	0.62
日本	国債証券	3 3 9 1 0年国債	785,000,000	101.40	795,974,300	101.06	793,305,300	0.400	2025/06/20	0.62
日本	国債証券	1 7 4 2 0年国債	880,000,000	94.24	829,312,000	89.71	789,465,600	0.400	2040/09/20	0.61
日本	国債証券	7 2 2 0 年国債	753,000,000	105.03	790,883,430	103.85	781,998,030	2.100	2024/09/20	0.61
日本	国債証券	4 4 1 2 年国債	780,000,000	100.14	781,064,900	100.08	780,639,600	0.005	2024/10/01	0.61
日本	国債証券	3 4 0 1 0年国債	770,000,000	101.50	781,519,200	101.15	778,847,300	0.400	2025/09/20	0.60

## □ 種類別投資比率

2022年11月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	79.34
地方債証券	7.68
特殊債券	7.07
社債券	5.26
合計	99.35

## 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11月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	14,950,000	14,162.52	2,117,296,452	12,758.13	1,907,339,802	1.625	2026/05/15	1.24
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,300,000	14,533.58	1,932,965,969	13,069.47	1,738,239,817	2.250	2026/03/31	1.13
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,000,000	15,224.60	1,370,213,625	13,149.74	1,183,476,525	2.875	2028/05/15	0.77
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,700,000	13,722.02	1,056,595,727	13,137.24	1,011,567,546	0.125	2024/02/15	0.66
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	51,000,000	1,954.73	996,911,497	1,947.13	993,036,806	2.690	2026/08/12	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,500,000	13,577.74	1,154,107,603	11,424.70	971,099,162	1.125	2031/02/15	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,100,000	14,025.87	995,836,770	12,569.82	892,457,081	1.375	2026/08/31	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,500,000	14,322.50	930,962,260	13,423.73	872,542,429	2.125	2024/03/31	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,200,000	13,355.27	961,579,207	11,776.18	847,884,672	0.625	2027/12/31	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,500,000	13,070.03	980,252,084	11,080.72	831,053,628	0.625	2030/05/15	0.54

中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	42,000,000	1,975.12	829,548,726	1,964.43	825,060,573	3.020	2031/05/27	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,200,000	14,218.90	881,571,756	13,276.67	823,153,313	1.750	2024/06/30	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	13,301.11	931,077,522	11,214.72	785,030,721	0.875	2030/11/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	13,041.84	912,928,602	11,016.28	771,139,555	0.625	2030/08/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	14,460.81	824,266,217	13,454.00	766,878,190	2.500	2024/05/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,600,000	14,453.87	809,416,571	13,371.65	748,812,592	2.375	2024/08/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	13,844.39	789,130,315	12,921.85	736,545,649	2.875	2032/05/15	0.48
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,800,000	14,891.69	863,717,837	12,464.61	722,947,411	0.000	2030/08/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	14,130.02	777,151,237	13,125.30	721,891,392	1.500	2024/10/31	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	13,917.27	835,036,419	12,023.09	721,385,211	1.375	2028/10/31	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,900,000	13,598.29	802,299,066	11,833.67	698,186,422	1.000	2028/07/31	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,900,000	13,444.28	793,212,663	11,823.95	697,612,889	0.750	2028/01/31	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	14,500.39	739,519,828	13,560.93	691,607,595	2.750	2024/02/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	14,428.32	735,844,078	13,303.75	678,491,046	2.250	2024/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,200,000	13,832.70	719,300,495	12,914.35	671,546,435	0.750	2024/11/15	0.44
フランス	国債証券	FRANCE OAT.	4,800,000	14,563.32	699,039,331	13,961.00	670,128,062	0.000	2024/03/25	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	13,741.10	755,760,709	11,784.37	648,140,313	1.625	2031/05/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	14,424.01	721,200,514	12,829.64	641,482,191	2.000	2026/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	13,535.78	717,396,170	11,873.39	629,289,405	1.875	2032/02/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	15,090.17	724,328,144	13,094.89	628,554,504	2.750	2028/02/15	0.41

□ 種類別投資比率

2022年11月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.36
合計	98.36

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2022年11月30日現在



国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
中国	国債 証券	CHINA GOVERNMENT BOND	9,000,000	1,981.46	178,331,135	1,957.01	176,131,199	2.910	2028/10/14	0.73
中国	国債 証券	CHINA GOVERNMENT BOND	6,600,000	1,949.95	128,696,720	1,942.53	128,206,952	2.280	2024/03/17	0.53
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	970,000	13,246.25	128,488,662	13,137.24	127,431,236	0.125	2024/02/15	0.53
中国	国債 証券	CHINA GOVERNMENT BOND	6,500,000	1,943.77	126,345,248	1,924.16	125,070,582	2.480	2027/04/15	0.52
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	900,000	13,406.37	120,657,338	13,278.33	119,504,995	0.875	2024/01/31	0.49
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	910,000	13,607.59	123,829,101	12,921.85	117,588,866	2.875	2032/05/15	0.49
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	890,000	13,236.53	117,805,142	13,113.36	116,708,861	0.250	2024/03/15	0.48
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	1,010,000	11,960.60	120,802,013	11,403.59	115,176,236	1.375	2031/11/15	0.48
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	830,000	13,931.44	115,630,938	13,367.77	110,952,450	3.250	2029/06/30	0.46
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	930,000	12,348.46	114,840,671	11,784.37	109,594,634	1.625	2031/05/15	0.45
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	940,000	11,895.05	111,813,457	11,424.70	107,392,142	1.125	2031/02/15	0.44
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	920,000	11,891.72	109,403,785	11,347.07	104,393,022	1.250	2031/08/15	0.43
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	760,000	13,647.17	103,718,503	13,443.17	102,168,103	2.250	2024/03/31	0.42
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	850,000	12,485.25	106,124,592	11,873.39	100,923,772	1.875	2032/02/15	0.42
中国	国債 証券	CHINA GOVERNMENT BOND	5,000,000	1,986.94	99,346,821	1,964.43	98,221,496	3.020	2031/05/27	0.41
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	760,000	12,913.46	98,142,282	12,765.62	97,018,748	2.750	2032/08/15	0.40
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	730,000	12,745.07	93,039,025	12,423.87	90,694,219	1.250	2026/12/31	0.38
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	700,000	13,072.11	91,504,775	12,897.00	90,278,970	0.375	2024/09/15	0.37
中国	国債 証券	CHINA GOVERNMENT BOND	4,300,000	2,143.41	92,166,757	2,091.50	89,934,604	3.720	2051/04/12	0.37
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	730,000	12,446.22	90,857,433	12,078.36	88,172,006	1.250	2028/04/30	0.36
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	660,000	13,434.56	88,668,106	13,179.60	86,985,335	2.000	2025/02/15	0.36
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	660,000	13,605.93	89,799,118	13,123.22	86,613,219	2.875	2028/08/15	0.36

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	770,000	11,529.40	88,776,410	11,080.72	85,321,505	0.625	2030/05/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	660,000	13,110.16	86,527,064	12,914.35	85,234,739	0.750	2024/11/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	760,000	11,682.44	88,786,534	11,214.72	85,231,906	0.875	2030/11/15	0.35
フランス	国債証券	FRANCE OAT.	640,000	13,771.62	88,138,363	13,296.23	85,095,845	0.750	2028/05/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	630,000	13,692.72	86,264,141	13,454.00	84,760,221	2.500	2024/05/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	620,000	13,744.80	85,217,742	13,428.03	83,253,814	3.000	2025/09/30	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	630,000	13,227.78	83,335,039	13,087.39	82,450,535	0.375	2024/04/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	600,000	13,791.46	82,748,744	13,628.70	81,772,210	2.750	2023/11/15	0.34

## □ 種類別投資比率

2022年11月30日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	94.04
合計	94.04

## 米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

### イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2022年11月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
サウジアラビア	国債証券	SAUDI INTERNATIONAL BOND	1,400,000	12,261.94	171,667,205	11,302.77	158,238,754	2.250	2033/02/02	5.23
アラブ首長国連邦	国債証券	ABU DHABI GOVT INT'L	1,300,000	12,372.83	160,846,732	11,545.10	150,086,252	1.875	2031/09/15	4.96
カタール	国債証券	STATE OF QATAR	1,100,000	14,255.28	156,808,115	13,404.01	147,444,111	3.750	2030/04/16	4.88
オマーン	国債証券	OMAN GOV INTERNTL BOND	1,000,000	13,965.68	139,656,837	13,895.33	138,953,322	6.250	2031/01/25	4.60
メキシコ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,200,000	11,850.40	142,204,824	11,524.54	138,294,522	2.659	2031/05/24	4.57
カタール	国債証券	STATE OF QATAR	900,000	13,218.51	118,966,596	12,779.37	115,014,355	4.400	2050/04/16	3.80
メキシコ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	900,000	11,681.81	105,136,255	11,815.34	106,338,036	5.000	2051/04/27	3.52
ドミニカ共和国	国債証券	DOMINICAN REPUBLIC	800,000	12,805.98	102,447,870	12,438.31	99,506,465	6.000	2033/02/22	3.29
トルコ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	800,000	11,166.19	89,329,516	12,371.79	98,974,315	6.125	2028/10/24	3.27

ペルー	国債証券	REPUBLIC OF PERU	800,000	11,756.56	94,052,484	11,695.91	93,567,273	2.783	2031/01/23	3.10
中国	国債証券	CHINA GOVT INTL BOND	700,000	12,821.93	89,753,486	12,512.19	87,585,309	1.250	2026/10/26	2.90
パナマ	国債証券	REPUBLIC OF PANAMA	800,000	9,929.05	79,432,390	10,135.01	81,080,082	4.500	2063/01/19	2.68
サウジアラビア	国債証券	SAUDI INTERNATIONAL BOND	600,000	13,922.74	83,536,415	13,282.78	79,696,659	3.625	2028/03/04	2.64
ブラジル	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	600,000	13,321.75	79,930,516	13,104.33	78,625,972	2.875	2025/06/06	2.60
チリ	国債証券	REPUBLIC OF CHILE	600,000	11,077.61	66,465,681	11,140.15	66,840,908	2.550	2033/07/27	2.21
アラブ首長国連邦	国債証券	ABU DHABI GOVT INT'L	500,000	13,401.90	67,009,496	13,330.96	66,654,822	2.500	2025/04/16	2.20
パナマ	国債証券	REPUBLIC OF PANAMA	600,000	11,109.74	66,658,433	10,459.69	62,758,130	2.252	2032/09/29	2.08
ドミニカ共和国	国債証券	DOMINICAN REPUBLIC	600,000	9,995.24	59,971,426	10,200.14	61,200,842	5.875	2060/01/30	2.02
コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	600,000	10,545.00	63,270,005	10,159.73	60,958,375	3.125	2031/04/15	2.02
ブラジル	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	500,000	12,497.33	62,486,639	12,086.13	60,430,669	3.875	2030/06/12	2.00
ウルグアイ	国債証券	REPUBLICA ORIENT URUGUAY	400,000	13,940.46	55,761,859	13,908.94	55,635,765	4.375	2031/01/23	1.84
オマーン	国債証券	OMAN GOV INTERNTL BOND	400,000	13,187.65	52,750,602	13,798.96	55,195,825	6.000	2029/08/01	1.83
インドネシア	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	400,000	13,183.76	52,735,049	13,425.67	53,702,695	5.125	2045/01/15	1.78
トルコ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	400,000	12,533.99	50,135,958	13,354.29	53,417,178	6.375	2025/10/14	1.77
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	400,000	13,512.47	54,049,870	13,190.43	52,761,712	5.875	2030/06/22	1.75
チリ	国債証券	REPUBLIC OF CHILE	400,000	12,895.75	51,582,983	12,889.08	51,556,320	2.750	2027/01/31	1.71
アラブ首長国連邦	国債証券	ABU DHABI GOVT INT'L	500,000	11,357.82	56,789,081	10,294.16	51,470,776	3.125	2049/09/30	1.70
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	400,000	12,786.59	51,146,376	12,619.67	50,478,689	4.850	2029/09/30	1.67
チリ	国債証券	REPUBLIC OF CHILE	400,000	12,803.81	51,215,256	11,879.08	47,516,314	4.340	2042/03/07	1.57
メキシコ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	300,000	10,842.97	32,528,908	11,120.02	33,360,045	4.500	2050/01/31	1.10

□ 種類別投資比率

2022年11月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	95.75
合計	95.75

## 投資不動産物件

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

該当事項はありません。

## 外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

## エマージング株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

## Jリート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

## 外国リート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## 米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

2022年11月30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 0412 月 2022年 12月	買建	229	日本・円	4,351,796,900	4,557,100,000	2.05

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

## 外国株式インデックス・マザーファンド

2022年11月30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	I C E - E U	F T S E 1 0 I D X F U T D E C 2 2 2022年12 月	買 建	77	イ ギ リ ス ・ ポ ン ド	5,624,359.00	934,937,196	5,795,790.00	963,434,171	0.22
	ド イ ツ	E U R E X	E U R O S T O X X 5 0 D E C 2 2 2022年12 月	買 建	547	ユ ー ロ	20,681,394.00	2,969,434,550	21,518,980.00	3,089,695,148	0.70
	ア メ リ カ	シ カ ゴ 商 品 取 引 所	S & P 5 0 0 E M I N I F U T D E C 2 2 2022年12 月	買 建	581	ア メ リ カ ・ ド ル	113,042,530.50	15,698,216,210	115,096,100.00	15,983,395,407	3.61
	オ ー ス ト ラ リ ア	シ ド ニー 先 物 取 引 所	S P I 2 0 0 F U T U R E S D E C 2 2 2022年 12月	買 建	45	オ ー ス ト ラ リ ア ・ ド ル	7,918,477.50	734,755,527	8,167,500.00	757,862,325	0.17

(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11月30日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	買建	15,118,000.00	2,099,249,487	2,098,826,011	0.47
	ユーロ	買建	1,189,000.00	171,328,650	170,699,141	0.04
	カナダ・ドル	買建	1,033,000.00	106,801,796	105,519,193	0.02
	スイス・フラン	買建	622,000.00	91,286,164	90,606,304	0.02
	イギリス・ポンド	買建	524,000.00	87,718,707	87,086,511	0.02
	オーストラリア・ドル	買建	366,000.00	34,202,370	33,957,955	0.01
	スウェーデン・クローナ	買建	2,324,000.00	30,621,024	30,535,733	0.01
	デンマーク・クローネ	買建	1,268,000.00	24,504,100	24,483,812	0.01
	ユーロ	売建	2,124,000.00	305,223,048	304,949,052	0.07
	イギリス・ポンド	売建	539,000.00	89,625,998	89,588,968	0.02
オーストラリア・ドル	売建	784,000.00	72,454,928	72,740,539	0.02	

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

#### エマージング株式インデックス・マザーファンド

2022年11月30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	アメ リカ	I C E - U S	M S C I E M G M K T D E C 2 2 2022 年12月	買建	794	アメ リカ・ド ル	37,472,654.00	5,203,827,460	37,957,170.00	5,271,112,197	19.85
----------------------	----------	-------------------	---	----	-----	-----------------	---------------	---------------	---------------	---------------	-------

(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11月30日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	買建	1,888,246.68	262,300,000	262,124,442	0.99

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

#### Jリート・インデックス・マザーファンド

2022年11月30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 (%)
リート指 数先物取 引	日本	大阪取引 所	T R E I T 先 物 0 4 1 2 月 2 0 2 2 年 1 2 月	買建	20	日本・円	40,146,400	39,400,000	0.37

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

#### 外国リート・インデックス・マザーファンド

2022年11月30日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	買建	936,365.97	130,100,000	130,003,672	0.52
	オーストラリア・ドル	買建	153,543.97	14,300,000	14,243,620	0.06
	シンガポール・ドル	買建	22,775.98	2,300,000	2,300,972	0.01
	イギリス・ポンド	買建	10,723.32	1,800,000	1,782,358	0.01

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

#### 国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

#### 外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

#### ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2022年11月30日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	売建	81,560,000.00	12,075,594,168	11,314,060,292	46.80
	ユーロ	売建	53,160,000.00	7,789,146,732	7,629,735,840	31.56
	イギリス・ポンド	売建	6,340,000.00	1,077,748,012	1,053,053,078	4.36

オフショア・人民元	売建	39,590,000.00	798,499,024	768,263,745	3.18
カナダ・ドル	売建	4,550,000.00	494,543,868	464,403,485	1.92
オーストラリア・ドル	売建	3,780,000.00	358,169,969	350,484,246	1.45
シンガポール・ドル	売建	2,180,000.00	227,863,410	220,028,926	0.91
メキシコ・ペソ	売建	26,940,000.00	200,092,809	194,000,328	0.80
ポーランド・ズロチ	売建	2,990,000.00	92,246,792	91,521,209	0.38
イスラエル・シケル	売建	2,110,000.00	88,411,168	85,029,835	0.35
デンマーク・クローネ	売建	4,350,000.00	85,704,614	83,963,700	0.35
スウェーデン・クローナ	売建	4,400,000.00	59,122,185	57,792,680	0.24
ニュージーランド・ドル	売建	560,000.00	48,259,344	48,185,032	0.20
ノルウェー・クローネ	売建	3,410,000.00	48,570,301	47,362,513	0.20

(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。

#### 米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

2022年11月30日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	買建	70,000.00	9,698,080	9,719,591	0.32

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

#### 参考情報

基準日:2022年11月30日

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

## 基準価額・純資産の推移

### ■安定型



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

## 分配の推移

決算期	分配金
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。

### ■安定成長型



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
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。

### ■成長型



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
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

### ■安定型

#### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	90.00
投資証券	アメリカ	8.13
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.87
合計(純資産総額)		100.00

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	40.46
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	21.10
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)	7.37
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	6.65
アメリカ	投資証券	SPDR ブルームバーグ・ハイ・イールド債券ETF	4.89
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	4.34
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	4.02
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	3.64
アメリカ	投資証券	バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF	3.24
日本	親投資信託受益証券	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド	1.98

### ■安定成長型

#### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	87.06
投資証券	アメリカ	10.77
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.17
合計(純資産総額)		100.00

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	24.42
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	12.99
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)	12.21
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	10.20
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	8.65
アメリカ	投資証券	SPDR ブルームバーグ・ハイ・イールド債券ETF	7.53
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	6.78
日本	親投資信託受益証券	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド	5.60
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	5.53
アメリカ	投資証券	バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF	3.24

### ■成長型

#### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	84.49
投資証券	アメリカ	13.22
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.29
合計(純資産総額)		100.00

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	15.46
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	14.07
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	12.53
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	10.64
アメリカ	投資証券	SPDR ブルームバーグ・ハイ・イールド債券ETF	9.38
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	8.66
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	7.86
日本	親投資信託受益証券	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド	7.46
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	6.86
アメリカ	投資証券	バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF	3.83

\*比率は、ファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

## ▶ 投資対象とする投資信託の現況

## ■ 国内債券パッシブ・マザーファンド

## 主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	国債証券	367 10年国債	0.200	2032/06/20	1.95
日本	国債証券	438 2年国債	0.005	2024/07/01	1.82
日本	国債証券	153 5年国債	0.005	2027/06/20	1.47
日本	国債証券	147 5年国債	0.005	2026/03/20	1.19
日本	国債証券	148 5年国債	0.005	2026/06/20	1.19

## ■ 外国債券パッシブ・マザーファンド

## 主要投資銘柄(上位5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	1.24
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2026/03/31	1.13
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.875	2028/05/15	0.77
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.125	2024/02/15	0.66
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.690	2026/08/12	0.64

## ■ ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

## 主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.910	2028/10/14	0.73
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.280	2024/03/17	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.125	2024/02/15	0.53
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.480	2027/04/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.875	2024/01/31	0.49

## ■ ミドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

## 主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
サウジアラビア	国債証券	SAUDI INTERNATIONAL BOND	2.250	2033/02/02	5.23
アラブ首長国連邦	国債証券	ABU DHABI GOVT INTL	1.875	2031/09/15	4.96
カタール	国債証券	STATE OF QATAR	3.750	2030/04/16	4.88
オマーン	国債証券	OMAN GOV INTERNTL BOND	6.250	2031/01/25	4.60
メキシコ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2.659	2031/05/24	4.57

\*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。

## ■国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

## 主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	3.77
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2.72
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.95
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.68
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.66

## ■外国株式インデックス・マザーファンド

## 主要投資銘柄(上位5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	4.54
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	3.40
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	1.68
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	1.14
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1.07

## ■エマージング株式インデックス・マザーファンド

## 主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	5.01
香港	投資信託受益証券	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	—	4.07
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	—	3.40
ケイマン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	2.95
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.82

※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。

## ■リート・インデックス・マザーファンド

## 主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	6.71
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	5.47
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	5.01
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	4.99
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	4.97

## ■外国リート・インデックス・マザーファンド

## 主要投資銘柄(上位5銘柄)

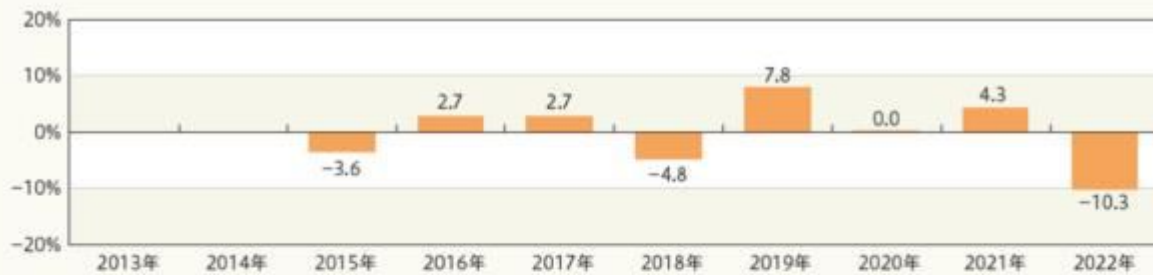
国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	8.12
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	4.73
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	3.56
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	2.99
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	2.99

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

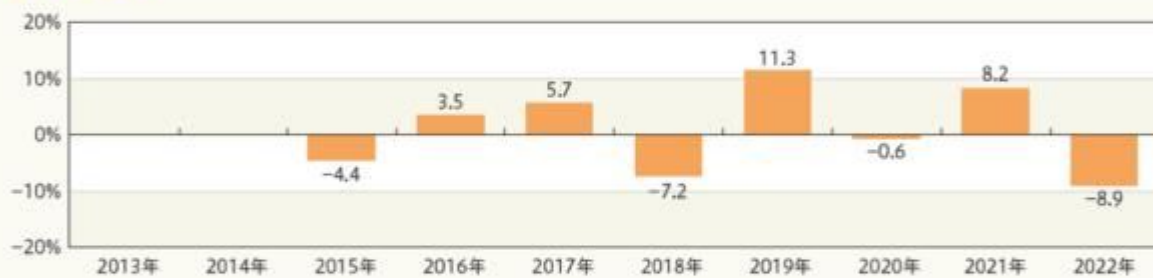


## 年間収益率の推移(暦年ベース)

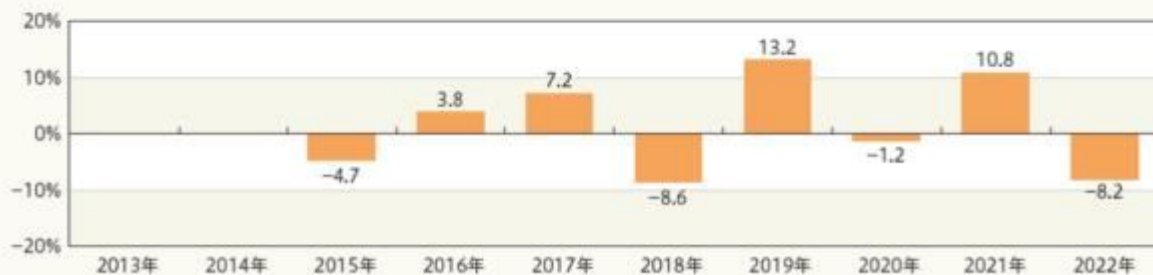
## ■安定型



## ■安定成長型



## ■成長型



※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。

※ファンドが設定された年の収益率は、設定日から年末までの騰落率です。

※2022年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。

※ファンドにはベンチマークはありません。

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込(販売)手続等】

## イ 申込方法

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

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

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

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

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

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

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

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

(二) 申込不可日

上記にかかわらず、取得申込日が以下のいずれかに当たる場合には、ファンドの取得申込みはできません（また、該当日には、解約請求のお申込みもできません。）。

- ・ニューヨークの取引所の休業日
- ・ニューヨークの銀行の休業日

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

ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

ハ 申込手数料

原則として、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）に、1.1%（税抜き1.0%）を上限として、販売会社がそれぞれ別に定める申込手数料率を乗じて得た額となります。

累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は無手数料となります。

申込手数料に関する詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社にお問い合わせください。

ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

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

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

## 2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

ただし、以下のいずれかに当たる場合には、解約請求の受け付けは行いません。

- ・ニューヨークの取引所の休業日
- ・ニューヨークの銀行の休業日

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して6営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### イ 基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産（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。）。投資対象とする投資信託証券は、原則として、基準価額計算日に知りうる直近の純資産価格（基準価額）で評価します。また、上場されている場合は、その主たる取引所における最終相場で評価します。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。

<マザーファンドの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。

#### □ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

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

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

#### （2）【保管】

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

#### （3）【信託期間】

2015年4月17日から2028年4月26日まで、もしくは下記「（5）その他 イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

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

#### （4）【計算期間】

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

#### （5）【その他】

##### イ 信託の終了

##### （イ）信託契約の解約

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

有し、これを行行使うことができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、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行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b～dまでの取扱いは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b～dまでの取扱いを行うことが困難な場合も同様とします。

(ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令

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

(ハ) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

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

(ニ) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

ロ 収益分配金、償還金の支払い

(イ) 収益分配金

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

(ロ) 償還金

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

八 信託約款の変更等

- (イ) 委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、



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

- (ロ) 委託会社は、上記(イ)の事項(変更についてはその内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- (ハ) 上記(ロ)の書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- (ニ) 書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います(書面決議は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。)
- (ホ) 上記(ロ)から(ニ)までの取扱いは、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- (ヘ) 上記にかかわらず、当ファンドと他のファンドとの併合の場合は、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、相手方となる他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、併合を行うことはできません。

## 二 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

## ホ 販売会社との契約の更改等

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

## へ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

## ト 公告

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

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

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

## チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

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

#### 4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

##### イ 分配金請求権

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

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

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

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

##### ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

##### ハ 一部解約実行請求権

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

##### ニ 書面決議における議決権

委託会社が、当ファンドの解約（監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。）または、重大な信託約款の変更等を行おうとする場合において、受益者は、それぞれの書面決議手続きにおいて、受益権の口数に応じて議決権を有しこれを行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7期(2021年4月27日から2022年4月26日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【アセットアロケーション・ファンド（安定型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第6期 （2021年 4月26日現在）	第7期 （2022年 4月26日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	5,447,013	6,519,262
金銭信託	85,182,095	5,267,383
コール・ローン	195,472,043	265,682,946
投資証券	1,641,605,935	548,941,349
親投資信託受益証券	9,175,043,571	8,542,893,732
派生商品評価勘定	17,974,382	5,895,945
未収入金	252,000,000	-
流動資産合計	11,372,725,039	9,375,200,617
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,246	23,270,080
未払金	217,000,000	-
未払解約金	10,479,125	7,753,468
未払受託者報酬	1,857,160	1,628,047
未払委託者報酬	55,714,730	48,842,701
未払利息	565	-
その他未払費用	379,237	326,177
流動負債合計	285,432,063	81,820,473
負債合計	285,432,063	81,820,473
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	10,377,601,105	9,092,669,568
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	709,691,871	200,710,576
（分配準備積立金）	939,762,037	888,061,340
元本等合計	11,087,292,976	9,293,380,144
純資産合計	11,087,292,976	9,293,380,144
負債純資産合計	11,372,725,039	9,375,200,617

## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第6期		第7期	
	自 至	2020年 4月28日 2021年 4月26日	自 至	2021年 4月27日 2022年 4月26日
<b>営業収益</b>				
受取配当金		47,150,361		45,310,452
受取利息		-		1,580
有価証券売買等損益		1,086,789,809		381,745,141
為替差損益		8,297,126		29,951,096
営業収益合計		1,125,643,044		306,482,013
<b>営業費用</b>				
支払利息		218,406		151,614
受託者報酬		3,963,119		3,406,397
委託者報酬		118,893,464		102,193,664
その他費用		1,063,181		892,699
営業費用合計		124,138,170		106,644,374
営業利益又は営業損失（ ）		1,001,504,874		413,126,387
経常利益又は経常損失（ ）		1,001,504,874		413,126,387
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,001,504,874		413,126,387
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		143,423,979		8,544,368
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		213,887,459		709,691,871
剰余金増加額又は欠損金減少額		65,498,435		11,494,615
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		57,572,481		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		7,925,954		11,494,615
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		98,805,155
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		98,805,155
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（ ）		709,691,871		200,710,576

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第7期	
	自 2021年4月27日 至 2022年4月26日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>	

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第6期	第7期
	(2021年4月26日現在)	(2022年4月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	10,377,601,105口	9,092,669,568口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0684円 (1万口当たりの純資産額10,684円)	1口当たり純資産額 1.0221円 (1万口当たりの純資産額10,221円)

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第6期	第7期
	自 2020年4月28日 至 2021年4月26日	自 2021年4月27日 至 2022年4月26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（193,123,580円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（100,008,997円）、収益調整金（146,397,297円）、および分配準備積立金（646,629,460円）より、分配対象収益は1,086,159,334円（1万口当たり1,046.62円）であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（78,167,127円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（142,046,902円）、および分配準備積立金（809,894,213円）より、分配対象収益は1,030,108,242円（1万口当たり1,132.90円）であります。分配を行っておりません。

## （金融商品に関する注記）

## ・金融商品の状況に関する事項

項目	第7期
	自 2021年4月27日 至 2022年4月26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項 目	第7期 (2022年4月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>



（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第6期（自 2020年4月28日 至 2021年4月26日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	14,418,270円
親投資信託受益証券	560,583,034円
合計	575,001,304円

第7期（自 2021年4月27日 至 2022年4月26日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	67,878,628円
親投資信託受益証券	290,586,290円
合計	358,464,918円

（デリバティブ取引に関する注記）

第6期（2021年4月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち 1年超		
市場取引 以外の取 引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	29,880,128	-	29,878,882	1,246
	小計	29,880,128	-	29,878,882	1,246
	売建				
	アメリカ・ドル	1,433,284,168	-	1,415,309,786	17,974,382
	小計	1,433,284,168	-	1,415,309,786	17,974,382
	合 計	1,463,164,296	-	1,445,188,668	17,973,136

第7期（2022年4月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち 1年超		
市場取引 以外の取 引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	383,424,516	-	389,063,520	5,639,004
	小計	383,424,516	-	389,063,520	5,639,004
	売建				
	アメリカ・ドル	760,852,301	-	783,865,440	23,013,139
	小計	760,852,301	-	783,865,440	23,013,139

合計	1,144,276,817	-	1,172,928,960	17,374,135
----	---------------	---	---------------	------------

## (注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

<p>第7期 自 2021年4月27日 至 2022年4月26日</p>
<p>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。</p>

## (その他の注記)

項目	第6期 (2021年4月26日現在)	第7期 (2022年4月26日現在)
期首元本額	13,933,783,423円	10,377,601,105円
期中追加設定元本額	246,744,303円	158,442,458円
期中一部解約元本額	3,802,926,621円	1,443,373,995円

## (4) 【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF	552.00	51,429.84	

		S P D R ブルームバ グ・ハイ・イールド債券E T F	27,130.00	2,697,807.20	
		バンガード・米ドル建て新 興国政府債券E T F	23,333.00	1,552,811.15	
		アメリカ・ドル小計	51,015.00	4,302,048.19 (548,941,349)	
投資証券合計				548,941,349 (548,941,349)	
親投資信託 受益証券	日本・円	国内株式インデックス・マ ザーファンド(B号)	146,334,176	465,269,512	
		外国株式インデックス・マ ザーファンド	96,142,646	580,047,811	
		ヘッジ付き外国債券パッシ ブ・マザーファンド	3,296,843,012	4,530,191,982	
		外国債券パッシブ・マザー ファンド	53,018,449	105,464,298	
		国内債券パッシブ・マザー ファンド	2,027,250,671	2,543,996,867	
		Jリート・インデックス・ マザーファンド	74,332,453	197,902,722	
		外国リート・インデック ス・マザーファンド	14,691,068	47,321,399	
		エマージング株式インデッ クス・マザーファンド	44,385,580	72,699,141	
		日本・円小計	5,752,998,055	8,542,893,732	
親投資信託受益証券合計				8,542,893,732 (-)	
合 計				9,091,835,081 (548,941,349)	

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

通貨	銘柄数	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 3銘柄	5.9%	100.0%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

## 【アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第6期 (2021年 4月26日現在)	第7期 (2022年 4月26日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	6,526,646	7,264,186
金銭信託	64,878,915	4,590,506
コール・ローン	148,881,218	231,541,783
投資証券	1,853,956,374	847,995,902
親投資信託受益証券	6,355,229,990	6,369,966,615
派生商品評価勘定	20,250,051	5,379,306
未収入金	218,000,000	-
流動資産合計	8,667,723,194	7,466,738,298
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,507	30,235,672
未払金	183,000,000	-
未払解約金	26,624,924	12,921,447
未払受託者報酬	1,377,585	1,282,383
未払委託者報酬	41,327,467	38,472,889
未払利息	430	-
その他未払費用	281,493	256,959
流動負債合計	252,613,406	83,169,350
<b>負債合計</b>		
	252,613,406	83,169,350
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	7,473,130,169	6,754,042,056
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	941,979,619	629,526,892
(分配準備積立金)	1,091,458,270	1,016,786,295
元本等合計	8,415,109,788	7,383,568,948
<b>純資産合計</b>		
	8,415,109,788	7,383,568,948
<b>負債純資産合計</b>		
	8,667,723,194	7,466,738,298

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第6期		第7期	
	自 2020年 4月28日 至 2021年 4月26日		自 2021年 4月27日 至 2022年 4月26日	
<b>営業収益</b>				
受取配当金		56,990,267		57,434,434
受取利息		-		1,308
有価証券売買等損益		1,398,939,615		227,907,788
為替差損益		8,135,920		38,708,008
営業収益合計		1,447,793,962		131,764,038
<b>営業費用</b>				
支払利息		165,025		118,276
受託者報酬		2,905,989		2,653,024
委託者報酬		87,179,688		79,592,645
その他費用		876,752		783,261
営業費用合計		91,127,454		83,147,206
営業利益又は営業損失( )		1,356,666,508		214,911,244
経常利益又は経常損失( )		1,356,666,508		214,911,244
当期純利益又は当期純損失( )		1,356,666,508		214,911,244
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( )		214,465,398		12,791,637
期首剰余金又は期首欠損金( )		328,493,306		941,979,619
剰余金増加額又は欠損金減少額		128,271,815		60,778,948
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		91,209,787		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		37,062,028		60,778,948
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		145,528,794
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		145,528,794
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( )		941,979,619		629,526,892

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第7期	
	自 2021年4月27日 至 2022年4月26日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>	

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第6期	第7期
	(2021年4月26日現在)	(2022年4月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	7,473,130,169口	6,754,042,056口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1260円 (1万口当たりの純資産額11,260円)	1口当たり純資産額 1.0932円 (1万口当たりの純資産額10,932円)

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

項 目	第6期	第7期
	自 2020年4月28日 至 2021年4月26日	自 2021年4月27日 至 2022年4月26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（170,801,351円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（340,858,056円）、収益調整金（190,066,868円）、および分配準備積立金（579,798,863円）より、分配対象収益は1,281,525,138円（1万口当たり1,714.83円）であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（88,539,085円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（230,995,369円）、および分配準備積立金（928,247,210円）より、分配対象収益は1,247,781,664円（1万口当たり1,847.46円）であります。分配を行っておりません。

## （金融商品に関する注記）

## ・金融商品の状況に関する事項

項 目	第7期
	自 2021年4月27日 至 2022年4月26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項 目	第7期 (2022年4月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>



（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第6期（自 2020年4月28日 至 2021年4月26日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	42,203,053円
親投資信託受益証券	821,418,669円
合計	863,621,722円

第7期（自 2021年4月27日 至 2022年4月26日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	116,327,820円
親投資信託受益証券	111,086,860円
合計	227,414,680円

（デリバティブ取引に関する注記）

第6期（2021年4月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち 1年超		
市場取引 以外の取 引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	36,136,617	-	36,135,110	1,507
	小計	36,136,617	-	36,135,110	1,507
	売建				
	アメリカ・ドル	1,616,990,449	-	1,596,740,398	20,250,051
	小計	1,616,990,449	-	1,596,740,398	20,250,051
	合 計	1,653,127,066	-	1,632,875,508	20,248,544

第7期（2022年4月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち 1年超		
市場取引 以外の取 引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	359,140,754	-	364,324,640	5,183,886
	小計	359,140,754	-	364,324,640	5,183,886
	売建				
	アメリカ・ドル	993,180,228	-	1,023,220,480	30,040,252
	小計	993,180,228	-	1,023,220,480	30,040,252

合計	1,352,320,982	-	1,387,545,120	24,856,366
----	---------------	---	---------------	------------

## (注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

<p>第7期 自 2021年4月27日 至 2022年4月26日</p>
<p>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。</p>

## (その他の注記)

項目	第6期 (2021年4月26日現在)	第7期 (2022年4月26日現在)
期首元本額	9,718,712,784円	7,473,130,169円
期中追加設定元本額	582,836,155円	430,295,633円
期中一部解約元本額	2,828,418,770円	1,149,383,746円

## (4) 【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF	397.00	36,988.49	

		S P D R ブルームバーク・ハイ・イールド債券 E T F	32,498.00	3,231,601.12	
		バンガード・米ドル建て新興国政府債券 E T F	50,746.00	3,377,146.30	
		アメリカ・ドル小計	83,641.00	6,645,735.91 (847,995,902)	
投資証券合計				847,995,902 (847,995,902)	
親投資信託 受益証券	日本・円	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	231,330,362	735,514,885	
		外国株式インデックス・マザーファンド	103,195,277	622,597,745	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	1,961,569,030	2,695,392,004	
		外国債券パッシブ・マザーファンド	75,940,895	151,061,628	
		国内債券パッシブ・マザーファンド	1,067,412,920	1,339,496,473	
		Jリート・インデックス・マザーファンド	144,802,192	385,521,355	
		外国リート・インデックス・マザーファンド	15,848,872	51,050,801	
		エマージング株式インデックス・マザーファンド	237,701,767	389,331,724	
		日本・円小計	3,837,801,315	6,369,966,615	
親投資信託受益証券合計				6,369,966,615 (-)	
合 計				7,217,962,517 (847,995,902)	

(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 3銘柄	11.5%	100.0%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

## 【アセットアロケーション・ファンド(成長型)】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第6期 (2021年 4月26日現在)	第7期 (2022年 4月26日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
預金	4,349,004	4,860,644
金銭信託	32,679,457	2,166,589
コール・ローン	74,991,350	109,281,183
投資証券	1,098,520,919	573,295,985
親投資信託受益証券	3,217,727,090	3,227,244,365
派生商品評価勘定	11,170,836	3,427,731
未収入金	115,000,000	13,877,636
流動資産合計	4,554,438,656	3,934,154,133
<b>資産合計</b>		
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
派生商品評価勘定	927	20,302,332
未払金	93,000,000	-
未払解約金	18,555,950	16,630,402
未払受託者報酬	731,097	674,070
未払委託者報酬	21,932,874	20,223,281
未払利息	217	-
その他未払費用	149,436	135,057
流動負債合計	134,370,501	57,965,142
<b>負債合計</b>		
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	3,829,011,023	3,430,668,866
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	591,057,132	445,520,125
(分配準備積立金)	694,057,397	646,745,627
元本等合計	4,420,068,155	3,876,188,991
<b>純資産合計</b>		
	4,420,068,155	3,876,188,991
<b>負債純資産合計</b>		
	4,554,438,656	3,934,154,133

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第6期		第7期	
	自	2020年 4月28日 至 2021年 4月26日	自	2021年 4月27日 至 2022年 4月26日
<b>営業収益</b>				
受取配当金		37,795,984		37,046,473
受取利息		-		692
有価証券売買等損益		994,656,750		98,097,219
為替差損益		4,248,046		26,757,148
営業収益合計		1,028,204,688		34,292,906
<b>営業費用</b>				
支払利息		89,996		63,013
受託者報酬		1,615,399		1,404,907
委託者報酬		48,461,953		42,148,686
その他費用		556,172		447,800
営業費用合計		50,723,520		44,064,406
営業利益又は営業損失( )		977,481,168		78,357,312
経常利益又は経常損失( )		977,481,168		78,357,312
当期純利益又は当期純損失( )		977,481,168		78,357,312
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( )		206,066,625		8,809,801
期首剰余金又は期首欠損金( )		306,503,321		591,057,132
剰余金増加額又は欠損金減少額		126,145,910		30,153,861
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		115,843,460		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		10,302,450		30,153,861
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		88,523,755
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		88,523,755
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( )		591,057,132		445,520,125

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第7期	
	自 2021年4月27日 至 2022年4月26日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>	

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第6期	第7期
	(2021年4月26日現在)	(2022年4月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	3,829,011,023口	3,430,668,866口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1544円 (1万口当たりの純資産額11,544円)	1口当たり純資産額 1.1299円 (1万口当たりの純資産額11,299円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第6期	第7期
	自 2020年4月28日 至 2021年4月26日	自 2021年4月27日 至 2022年4月26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(96,013,619円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(250,271,896円)、収益調整金(107,986,469円)、および分配準備積立金(347,771,882円)より、分配対象収益は802,043,866円(1万口当たり2,094.63円)ですが、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(53,742,686円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(126,127,297円)、および分配準備積立金(593,002,941円)より、分配対象収益は772,872,924円(1万口当たり2,252.83円)ですが、分配を行っておりません。

## (金融商品に関する注記)

## ・金融商品の状況に関する事項

項目	第7期
	自 2021年4月27日 至 2022年4月26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項 目	第7期 (2022年4月26日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券（投資証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>



（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第6期（自 2020年4月28日 至 2021年4月26日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	37,458,619円
親投資信託受益証券	559,237,924円
合計	596,696,543円

第7期（自 2021年4月27日 至 2022年4月26日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	79,398,393円
親投資信託受益証券	11,794,368円
合計	91,192,761円

（デリバティブ取引に関する注記）

第6期（2021年4月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち 1年超		
市場取引 以外の取 引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	22,221,323	-	22,220,396	927
	小計	22,221,323	-	22,220,396	927
	売建				
	アメリカ・ドル	891,033,798	-	879,862,962	11,170,836
	小計	891,033,798	-	879,862,962	11,170,836
合 計		913,255,121	-	902,083,358	11,169,909

第7期（2022年4月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち 1年超		
市場取引 以外の取 引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	227,552,385	-	230,811,200	3,258,815
	小計	227,552,385	-	230,811,200	3,258,815
	売建				
	アメリカ・ドル	680,056,500	-	700,189,916	20,133,416
	小計	680,056,500	-	700,189,916	20,133,416

合計	907,608,885	-	931,001,116	16,874,601
----	-------------	---	-------------	------------

## (注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

<p>第7期 自 2021年4月27日 至 2022年4月26日</p>
<p>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。</p>

## (その他の注記)

項目	第6期 (2021年4月26日現在)	第7期 (2022年4月26日現在)
期首元本額	5,918,683,057円	3,829,011,023円
期中追加設定元本額	188,201,809円	172,858,285円
期中一部解約元本額	2,277,873,843円	571,200,442円

## (4) 【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF	207.00	19,286.19	

		SPDR ブルームバーグ・ハイ・イールド債券ETF	21,335.00	2,121,552.40	
		バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF	35,343.00	2,352,076.65	
		アメリカ・ドル小計	56,885.00	4,492,915.24 (573,295,985)	
投資証券合計				573,295,985 (573,295,985)	
親投資信託 受益証券	日本・円	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	152,943,467	486,283,753	
		外国株式インデックス・マザーファンド	68,329,125	412,243,276	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	794,172,937	1,091,273,032	
		外国債券パッシブ・マザーファンド	53,017,014	105,461,444	
		国内債券パッシブ・マザーファンド	428,125,024	537,254,092	
		Jリート・インデックス・マザーファンド	113,294,756	301,635,958	
		外国リート・インデックス・マザーファンド	10,883,264	35,056,081	
		エマージング株式インデックス・マザーファンド	157,541,199	258,036,729	
日本・円小計			1,778,306,786	3,227,244,365	
親投資信託受益証券合計				3,227,244,365 (-)	
合 計				3,800,540,350 (573,295,985)	

(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 3銘柄	14.8%	100.0%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

(参考)

「アセットアロケーション・ファンド(安定型)」、「アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)」および「アセットアロケーション・ファンド(成長型)」は、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「エマージング株式インデックス・マザーファンド」、「Jリート・インデックス・マザーファンド」、「外国リー

ト・インデックス・マザーファンド」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」および「ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

## 国内株式インデックス・マザーファンド( B号)

### ( 1 ) 貸借対照表

( 単位 : 円 )

	( 2021年4月26日現在 )	( 2022年4月26日現在 )
資産の部		
流動資産		
金銭信託	727,633,001	38,460,616
コール・ローン	1,668,590,743	1,939,925,432
株式	187,837,731,440	196,699,150,170
派生商品評価勘定	1,611,200	10,660,800
未収配当金	1,741,114,046	2,368,445,415
前払金	83,065,000	120,890,000
差入委託証拠金	13,270,000	183,300,000
流動資産合計	192,073,015,430	201,360,832,433
資産合計	192,073,015,430	201,360,832,433
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	84,886,300	123,711,500
未払解約金	497,729,231	95,194,113
未払利息	4,829	-
その他未払費用	57,245	4,482
流動負債合計	582,677,605	218,910,095
負債合計	582,677,605	218,910,095
純資産の部		
元本等		
元本	60,391,040,010	63,261,805,196
剰余金		
剰余金又は欠損金 ( )	131,099,297,815	137,880,117,142
元本等合計	191,490,337,825	201,141,922,338
純資産合計	191,490,337,825	201,141,922,338
負債純資産合計	192,073,015,430	201,360,832,433

### ( 2 ) 注記表

#### ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2021年4月27日 至 2022年4月26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。

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	（2021年4月26日現在）	（2022年4月26日現在）
1. 担保資産	<p>デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>株式 3,306,000,000円</p>	
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	60,391,040,010口	63,261,805,196口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.1708円 （1万口当たりの純資産額31,708円）	1口当たり純資産額 3.1795円 （1万口当たりの純資産額31,795円）

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年4月27日 至 2022年4月26日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>

<p>2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク</p>	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド(外部ファンド)を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年4月26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26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX先物	3,747,610,100	-	3,664,335,000	83,275,100
	小計	3,747,610,100	-	3,664,335,000	83,275,100
合計		3,747,610,100	-	3,664,335,000	83,275,100

(2022年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX先物 0406 月	4,559,170,700	-	4,446,120,000	113,050,700
	小計	4,559,170,700	-	4,446,120,000	113,050,700

合 計	4,559,170,700	-	4,446,120,000	113,050,700
-----	---------------	---	---------------	-------------

## (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27日 至 2022年4月26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26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	66,420,614,464円
同期中における追加設定元本額	10,321,155,755円
同期中における一部解約元本額	16,350,730,209円
2021年4月26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	9,377,992,498円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	882,687,081円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,279,019,277円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,170,940,243円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	121,064,129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)	4,744,492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)	20,265,196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)	59,910,031円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	126,034,866円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	99,406,160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)	198,180,525円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,201,230,099円
三井住友・DCつみたてN I S A・日本株インデックスファンド	16,039,342,551円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	423,754,988円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	464,864,383円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	302,064,707円
イオン・バランス戦略ファンド	48,431,067円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	23,321,027円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	134,683,136円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	112,157,344円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	371,384,457円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	185,233,234円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	216,782,444円



三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	24,448,491円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	223,855,528円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	11,130,956円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	50,852,277円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	47,513,827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)	3,065,048,127円
バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	18,087,538円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型 < 適格機関投資家限定 >	129,489,749円
SMAM・バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 >	2,117,958,002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 >	800,989,888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 >	888,393,536円
SMAM・バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 >	684,285,651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 >	373,938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 >	35,991,493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 >	132,156,315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 >	72,269,436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 >	280,176,797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 >	692,837,428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 < 適格機関投資家限定 >	382,523,535円
合計	60,391,040,010円

(2022年4月26日現在)

開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額

60,391,040,010円

同期中における追加設定元本額

11,694,994,809円

同期中における一部解約元本額	8,824,229,623円
2022年4月26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	9,498,830,729円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	981,562,776円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,546,847,970円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,448,440,778円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	129,139,788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)	20,168,646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)	63,518,648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)	153,838,056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)	245,294,698円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,502,049,659円
三井住友・DCつみたてN I S A・日本株インデックスファンド	19,696,465,018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D S・DCターゲットイヤーファンド2050	32,080,235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)	166,474,648円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	591,913,486円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	322,705,825円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	368,867,306円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	41,699,673円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	551,666,449円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	17,990,681円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	90,470,993円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	95,218,221円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	4,109,911円
日興F W S・日本株インデックス	592,212,994円
三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド	5,338,179円
S M A M・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,749,396,476円
バランスファンドV A(安定運用型) <適格機関投資家限定>	18,579,823円
S M A M・バランスファンドV A安定成長型 <適格機関投資家限定>	97,797,524円
S M A M・バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	1,766,376,348円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	1,639,438,827円
S M A M・バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	6,218,766,294円
S M A M・バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	40,740,210円
S M A M・バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定>	159,471,500円
S M A M・バランスファンドV A 7 5 <適格機関投資家専用>	740,333,728円
S M A M・バランスファンドV L 国際分散型 <適格機関投資家限定>	46,826,720円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5 <適格機関投資家専用>	257,810,451円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0 <適格機関投資家専用>	839,187,037円
S M A M・バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用>	607,019,790円
S M A M・バランスファンドV A 3 5 <適格機関投資家専用>	1,875,496,934円
S M A M・バランスV A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>	41,090,482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>	601,112,754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>	222,266,350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<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>	12,284,348円
合計	63,261,805,196円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

(単位:円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	3,700	3,265.000	12,080,500	
日本水産	102,500	567.000	58,117,500	
マル八二チロ	15,800	2,382.000	37,635,600	
雪国まいたけ	8,300	1,070.000	8,881,000	
カネコ種苗	5,000	1,684.000	8,420,000	
サカタのタネ	12,100	4,290.000	51,909,000	
ホクト	8,700	2,010.000	17,487,000	
日鉄鉱業	2,400	6,270.000	15,048,000	
三井松島ホールディングス	4,800	2,016.000	9,676,800	
INPEX	396,200	1,465.000	580,433,000	
石油資源開発	12,300	2,467.000	30,344,100	
K&Oエナジーグループ	5,600	1,631.000	9,133,600	
ヒノキヤグループ	2,900	2,337.000	6,777,300	
ショーボンドホールディングス	14,700	5,380.000	79,086,000	
ミライト・ホールディングス	33,100	1,783.000	59,017,300	
タマホーム	6,300	2,541.000	16,008,300	
ベステラ	4,200	1,169.000	4,909,800	

Robot Home	22,100	201.000	4,442,100
安藤・間	51,300	880.000	45,144,000
東急建設	32,200	594.000	19,126,800
コムシスホールディングス	33,100	2,658.000	87,979,800
ビーアールホールディングス	19,200	287.000	5,510,400
高松コンストラクショングループ	6,900	2,154.000	14,862,600
東建コーポレーション	2,900	8,500.000	24,650,000
ヤマウラ	4,000	918.000	3,672,000
オリエンタル白石	38,500	227.000	8,739,500
大成建設	69,200	3,420.000	236,664,000
大林組	239,100	881.000	210,647,100
清水建設	224,100	686.000	153,732,600
飛島建設	9,200	1,006.000	9,255,200
長谷工コーポレーション	70,500	1,394.000	98,277,000
松井建設	11,900	655.000	7,794,500
銭高組	1,800	3,885.000	6,993,000
鹿島建設	175,300	1,430.000	250,679,000
不動テトラ	6,200	1,512.000	9,374,400
大末建設	4,100	1,282.000	5,256,200
鉄建建設	7,100	1,816.000	12,893,600
西松建設	14,700	3,750.000	55,125,000
三井住友建設	56,900	414.000	23,556,600
大豊建設	3,800	4,480.000	17,024,000
奥村組	14,000	3,005.000	42,070,000
東鉄工業	10,800	2,113.000	22,820,400
浅沼組	2,900	5,090.000	14,761,000
戸田建設	99,700	731.000	72,880,700
熊谷組	11,900	2,675.000	31,832,500
北野建設	3,000	2,088.000	6,264,000
矢作建設工業	12,900	795.000	10,255,500
ピーエス三菱	9,900	557.000	5,514,300
日本ハウスホールディングス	20,200	435.000	8,787,000
大東建託	24,500	12,270.000	300,615,000
新日本建設	10,900	689.000	7,510,100
東亜道路工業	1,600	4,860.000	7,776,000
日本道路	2,400	7,320.000	17,568,000
東亜建設工業	6,400	2,791.000	17,862,400
日本国土開発	24,000	537.000	12,888,000
若築建設	5,200	1,872.000	9,734,400
五洋建設	95,400	618.000	58,957,200
世紀東急工業	13,000	717.000	9,321,000
福田組	2,800	4,500.000	12,600,000
住友林業	61,100	2,031.000	124,094,100
日本基礎技術	8,100	761.000	6,164,100
巴コーポレーション	14,600	459.000	6,701,400
大和ハウス工業	221,600	3,075.000	681,420,000
ライト工業	14,700	1,896.000	27,871,200
積水ハウス	260,300	2,233.500	581,380,050

北陸電気工事	6,600	763.000	5,035,800
ユアテック	14,900	663.000	9,878,700
日本リーテック	6,100	1,181.000	7,204,100
四電工	3,000	1,710.000	5,130,000
中電工	10,900	2,041.000	22,246,900
関電工	37,500	808.000	30,300,000
きんでん	52,900	1,520.000	80,408,000
東京エネシス	9,700	954.000	9,253,800
トーエネック	2,900	3,215.000	9,323,500
住友電設	6,300	2,137.000	13,463,100
日本電設工業	12,700	1,581.000	20,078,700
エクシオグループ	35,500	2,109.000	74,869,500
新日本空調	6,800	1,817.000	12,355,600
九電工	18,500	2,887.000	53,409,500
三機工業	15,000	1,430.000	21,450,000
日揮ホールディングス	73,900	1,419.000	104,864,100
中外炉工業	3,900	1,445.000	5,635,500
ヤマト	9,800	805.000	7,889,000
太平電業	5,700	2,665.000	15,190,500
高砂熱学工業	21,100	1,656.000	34,941,600
朝日工業社	4,600	1,541.000	7,088,600
明星工業	17,400	676.000	11,762,400
大気社	11,700	3,105.000	36,328,500
ダイダン	5,700	2,058.000	11,730,600
日比谷総合設備	8,100	1,888.000	15,292,800
テスホールディングス	5,900	1,342.000	7,917,800
インフロニア・ホールディングス	102,000	945.000	96,390,000
東洋エンジニアリング	12,400	601.000	7,452,400
レイズネクスト	11,800	1,053.000	12,425,400
ニッポン	20,900	1,682.000	35,153,800
日清製粉グループ本社	86,300	1,735.000	149,730,500
昭和産業	7,100	2,621.000	18,609,100
鳥越製粉	4,900	653.000	3,199,700
中部飼料	9,400	1,020.000	9,588,000
フィード・ワン	11,400	669.000	7,626,600
日本甜菜製糖	5,300	1,621.000	8,591,300
D M三井製糖ホールディングス	6,400	1,945.000	12,448,000
日新製糖	4,400	1,677.000	7,378,800
森永製菓	18,100	4,010.000	72,581,000
中村屋	3,200	3,185.000	10,192,000
江崎グリコ	21,100	3,760.000	79,336,000
名糖産業	5,100	1,634.000	8,333,400
井村屋グループ	4,900	2,264.000	11,093,600
不二家	4,400	2,393.000	10,529,200
山崎製パン	58,000	1,604.000	93,032,000
モロゾフ	3,000	2,986.000	8,958,000
亀田製菓	4,400	4,095.000	18,018,000
寿スピリッツ	7,400	6,780.000	50,172,000

カルビー	35,100	2,308.000	81,010,800
森永乳業	14,300	5,180.000	74,074,000
六甲バター	6,600	1,512.000	9,979,200
ヤクルト本社	57,000	6,640.000	378,480,000
明治ホールディングス	50,600	6,440.000	325,864,000
雪印メグミルク	18,700	1,937.000	36,221,900
プリマハム	9,100	2,145.000	19,519,500
日本ハム	29,300	4,125.000	120,862,500
丸大食品	8,400	1,490.000	12,516,000
S Foods	6,800	2,986.000	20,304,800
柿安本店	3,000	2,328.000	6,984,000
伊藤ハム米久ホールディングス	45,600	652.000	29,731,200
サッポロホールディングス	26,100	2,485.000	64,858,500
アサヒグループホールディングス	180,900	4,616.000	835,034,400
キリンホールディングス	282,700	1,832.000	517,906,400
宝ホールディングス	52,100	1,076.000	56,059,600
オエノンホールディングス	25,700	307.000	7,889,900
養命酒製造	3,800	1,745.000	6,631,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	54,100	1,466.000	79,310,600
サントリー食品インターナショナル	51,300	5,070.000	260,091,000
ダイドーグループホールディングス	3,900	4,950.000	19,305,000
伊藤園	23,300	5,270.000	122,791,000
キーコーヒー	7,700	2,004.000	15,430,800
日清オイリオグループ	9,000	2,923.000	26,307,000
不二製油グループ本社	16,900	1,790.000	30,251,000
かどや製油	1,400	3,540.000	4,956,000
J - オイルミルズ	7,700	1,570.000	12,089,000
キッコーマン	55,300	8,470.000	468,391,000
味の素	169,700	3,376.000	572,907,200
ブルドックソース	4,200	1,974.000	8,290,800
キューピー	40,400	2,177.000	87,950,800
ハウス食品グループ本社	28,600	2,974.000	85,056,400
カゴメ	29,300	3,235.000	94,785,500
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	5,060.000	35,926,000
ニチレイ	35,100	2,322.000	81,502,200
東洋水産	36,900	3,975.000	146,677,500
イトアンドホールディングス	3,900	2,154.000	8,400,600
日清食品ホールディングス	30,100	9,020.000	271,502,000
永谷園ホールディングス	4,200	1,948.000	8,181,600
一正蒲鉾	3,100	817.000	2,532,700
フジッコ	7,700	2,006.000	15,446,200
ロック・フィールド	8,200	1,485.000	12,177,000
日本たばこ産業	412,300	2,191.500	903,555,450
ケンコーマヨネーズ	5,500	1,406.000	7,733,000
わらべや日洋ホールディングス	5,400	1,639.000	8,850,600
なとり	5,200	1,981.000	10,301,200

ピクルスコーポレーション	4,200	1,280.000	5,376,000
ファーマフーズ	7,400	1,868.000	13,823,200
ユーグレナ	39,700	871.000	34,578,700
紀文食品	5,400	1,020.000	5,508,000
ミヨシ油脂	5,300	1,116.000	5,914,800
理研ビタミン	8,100	1,710.000	13,851,000
片倉工業	8,700	2,368.000	20,601,600
グンゼ	5,100	3,715.000	18,946,500
東洋紡	30,400	1,045.000	31,768,000
ユニチカ	24,300	274.000	6,658,200
富士紡ホールディングス	3,600	3,075.000	11,070,000
倉敷紡績	7,100	1,734.000	12,311,400
シキボウ	8,500	873.000	7,420,500
日本毛織	22,700	957.000	21,723,900
帝国繊維	8,900	1,595.000	14,195,500
帝人	70,000	1,368.000	95,760,000
東レ	541,100	613.900	332,181,290
住江織物	2,600	1,876.000	4,877,600
アツギ	10,200	521.000	5,314,200
ダイニック	7,400	729.000	5,394,600
セーレン	15,500	2,032.000	31,496,000
小松マテーレ	13,000	1,445.000	18,785,000
ワコールホールディングス	19,500	1,841.000	35,899,500
ホギメディカル	10,200	3,200.000	32,640,000
T S Iホールディングス	29,400	295.000	8,673,000
マツオカコーポレーション	3,500	1,086.000	3,801,000
ワールド	11,000	1,241.000	13,651,000
オンワードホールディングス	47,400	245.000	11,613,000
ゴールドウイン	13,500	6,210.000	83,835,000
デサント	14,500	2,573.000	37,308,500
特種東海製紙	4,800	3,435.000	16,488,000
王子ホールディングス	313,700	615.000	192,925,500
日本製紙	36,700	1,028.000	37,727,600
北越コーポレーション	49,800	660.000	32,868,000
大王製紙	37,000	1,505.000	55,685,000
レンゴー	72,300	775.000	56,032,500
トーモク	5,800	1,496.000	8,676,800
ザ・パックス	6,200	2,444.000	15,152,800
北の達人コーポレーション	28,600	173.000	4,947,800
クラレ	109,000	1,020.000	111,180,000
旭化成	497,600	1,043.500	519,245,600
昭和電工	65,000	2,414.000	156,910,000
住友化学	548,700	539.000	295,749,300
住友精化	3,700	3,015.000	11,155,500
日産化学	40,800	6,840.000	279,072,000
クレハ	5,800	9,590.000	55,622,000
多木化学	3,100	5,080.000	15,748,000
テイカ	6,300	1,181.000	7,440,300

石原産業	12,800	984.000	12,595,200
日本曹達	9,500	3,335.000	31,682,500
東ソー	107,700	1,737.000	187,074,900
トクヤマ	24,100	1,653.000	39,837,300
セントラル硝子	12,000	2,359.000	28,308,000
東亜合成	42,100	1,066.000	44,878,600
大阪ソーダ	6,900	3,150.000	21,735,000
関東電化工業	16,700	974.000	16,265,800
デンカ	27,400	3,355.000	91,927,000
信越化学工業	128,900	17,725.000	2,284,752,500
堺化学工業	5,600	1,812.000	10,147,200
第一稀元素化学工業	8,400	963.000	8,089,200
エア・ウォーター	71,200	1,650.000	117,480,000
日本酸素ホールディングス	72,100	2,206.000	159,052,600
日本化学工業	2,800	2,202.000	6,165,600
日本パーカライジング	37,400	892.000	33,360,800
高压ガス工業	13,900	630.000	8,757,000
四国化成工業	10,000	1,303.000	13,030,000
ステラ ケミファ	4,100	2,389.000	9,794,900
保土谷化学工業	2,600	3,595.000	9,347,000
日本触媒	12,700	5,170.000	65,659,000
大日精化工業	6,400	1,947.000	12,460,800
カネカ	19,300	3,415.000	65,909,500
三菱瓦斯化学	69,500	1,837.000	127,671,500
三井化学	67,700	2,899.000	196,262,300
J S R	69,900	3,370.000	235,563,000
東京応化工業	12,200	6,840.000	83,448,000
大阪有機化学工業	6,400	2,750.000	17,600,000
三菱ケミカルホールディングス	502,400	773.000	388,355,200
K Hネオケム	12,300	2,387.000	29,360,100
ダイセル	108,600	772.000	83,839,200
住友ベークライト	11,800	4,280.000	50,504,000
積水化学工業	156,500	1,668.000	261,042,000
日本ゼオン	67,800	1,287.000	87,258,600
アイカ工業	21,100	2,942.000	62,076,200
U B E	35,100	1,954.000	68,585,400
積水樹脂	11,300	1,759.000	19,876,700
タキロンシーアイ	17,600	543.000	9,556,800
旭有機材	4,900	1,853.000	9,079,700
ニチバン	5,600	1,710.000	9,576,000
リケンテクノス	20,300	446.000	9,053,800
大倉工業	4,500	1,835.000	8,257,500
群栄化学工業	2,300	2,782.000	6,398,600
ミライアル	3,100	1,635.000	5,068,500
ダイキョーニシカワ	17,700	502.000	8,885,400
森六ホールディングス	5,000	1,754.000	8,770,000
恵和	2,100	4,800.000	10,080,000
日本化薬	59,800	1,109.000	66,318,200



カーリットホールディングス	9,600	631.000	6,057,600
日本精化	6,300	2,036.000	12,826,800
扶桑化学工業	6,700	3,720.000	24,924,000
トリケミカル研究所	7,700	2,473.000	19,042,100
A D E K A	34,400	2,496.000	85,862,400
日油	25,600	4,775.000	122,240,000
新日本理化	20,100	261.000	5,246,100
ハリマ化成グループ	8,000	784.000	6,272,000
花王	169,800	5,201.000	883,129,800
第一工業製薬	3,100	2,560.000	7,936,000
石原ケミカル	5,000	1,268.000	6,340,000
ニイタカ	2,400	2,389.000	5,733,600
三洋化成工業	4,300	4,825.000	20,747,500
大日本塗料	12,000	770.000	9,240,000
日本ペイントホールディングス	282,400	1,022.000	288,612,800
関西ペイント	78,000	1,727.000	134,706,000
中国塗料	18,800	930.000	17,484,000
日本特殊塗料	7,600	805.000	6,118,000
藤倉化成	12,900	435.000	5,611,500
太陽ホールディングス	11,000	3,070.000	33,770,000
D I C	31,700	2,412.000	76,460,400
サカタインクス	15,100	942.000	14,224,200
東洋インキS Cホールディングス	14,800	1,915.000	28,342,000
T & K T O K A	8,700	783.000	6,812,100
富士フイルムホールディングス	134,900	7,175.000	967,907,500
資生堂	142,900	5,988.000	855,685,200
ライオン	93,200	1,329.000	123,862,800
高砂香料工業	5,400	2,587.000	13,969,800
マンダム	16,600	1,290.000	21,414,000
ミルボン	9,600	5,370.000	51,552,000
ファンケル	31,100	2,503.000	77,843,300
コーセー	14,500	12,720.000	184,440,000
コタ	6,400	1,398.000	8,947,200
ポーラ・オルビスホールディングス	33,000	1,512.000	49,896,000
ノエビアホールディングス	6,600	5,000.000	33,000,000
エステー	6,100	1,454.000	8,869,400
コニシ	12,900	1,522.000	19,633,800
長谷川香料	13,300	2,506.000	33,329,800
小林製薬	21,500	9,360.000	201,240,000
荒川化学工業	7,900	1,040.000	8,216,000
メック	5,800	2,547.000	14,772,600
タカラバイオ	20,100	2,125.000	42,712,500
J C U	8,500	3,220.000	27,370,000
O A Tアグリオ	4,200	1,122.000	4,712,400
デクセリアルズ	20,000	2,845.000	56,900,000
アース製薬	6,300	5,380.000	33,894,000
北興化学工業	8,100	978.000	7,921,800
大成ラミック	3,500	2,591.000	9,068,500

クミアイ化学工業	29,000	877.000	25,433,000
日本農薬	16,600	593.000	9,843,800
アキレス	6,800	1,288.000	8,758,400
有沢製作所	12,300	898.000	11,045,400
日東電工	46,200	8,740.000	403,788,000
レック	11,600	861.000	9,987,600
藤森工業	6,700	3,510.000	23,517,000
前澤化成工業	6,900	1,275.000	8,797,500
未来工業	4,000	1,467.000	5,868,000
J S P	5,400	1,494.000	8,067,600
エフピコ	14,600	2,880.000	42,048,000
天馬	6,100	2,156.000	13,151,600
信越ポリマー	13,700	1,092.000	14,960,400
東リ	29,700	217.000	6,444,900
ニフコ	25,700	2,611.000	67,102,700
バルカー	6,200	2,520.000	15,624,000
ユニ・チャーム	147,700	4,453.000	657,708,100
協和キリン	89,600	2,692.000	241,203,200
武田薬品工業	602,300	3,692.000	2,223,691,600
アステラス製薬	664,300	2,042.000	1,356,500,600
住友ファーマ	47,500	1,115.000	52,962,500
塩野義製薬	96,300	7,086.000	682,381,800
日本新薬	20,100	8,730.000	175,473,000
中外製薬	239,600	3,860.000	924,856,000
科研製薬	12,300	3,850.000	47,355,000
エーザイ	91,600	5,604.000	513,326,400
ロート製薬	39,300	3,395.000	133,423,500
小野薬品工業	175,800	3,230.000	567,834,000
久光製薬	20,300	3,435.000	69,730,500
持田製薬	9,900	3,580.000	35,442,000
参天製薬	142,700	1,039.000	148,265,300
扶桑薬品工業	3,600	2,074.000	7,466,400
日本ケミファ	2,500	1,963.000	4,907,500
ツムラ	23,900	3,125.000	74,687,500
日医工	25,100	765.000	19,201,500
キッセイ薬品工業	13,300	2,530.000	33,649,000
生化学工業	13,400	824.000	11,041,600
栄研化学	13,300	1,710.000	22,743,000
鳥居薬品	4,300	3,165.000	13,609,500
J C Rファーマ	22,000	2,374.000	52,228,000
東和薬品	10,900	2,615.000	28,503,500
富士製薬工業	6,800	936.000	6,364,800
ゼリア新薬工業	13,900	1,933.000	26,868,700
第一三共	602,300	2,952.500	1,778,290,750
キョーリン製薬ホールディングス	15,000	1,835.000	27,525,000
大幸薬品	13,400	617.000	8,267,800
ダイト	5,100	2,568.000	13,096,800
大塚ホールディングス	159,200	4,280.000	681,376,000

大正製薬ホールディングス	18,100	4,895.000	88,599,500
ペプチドリーム	40,600	2,107.000	85,544,200
あすか製薬ホールディングス	9,500	1,178.000	11,191,000
サワイグループホールディングス	16,800	4,290.000	72,072,000
日本コークス工業	75,000	135.000	10,125,000
ニチレキ	10,500	1,162.000	12,201,000
ユシロ化学工業	7,200	1,010.000	7,272,000
富士石油	18,000	279.000	5,022,000
MORESCO	5,800	1,164.000	6,751,200
出光興産	84,500	3,335.000	281,807,500
ENEOSホールディングス	1,148,900	445.500	511,834,950
コスモエネルギーホールディングス	22,100	3,075.000	67,957,500
横浜ゴム	43,500	1,728.000	75,168,000
TOYO TIRE	40,200	1,475.000	59,295,000
ブリヂストン	220,700	4,767.000	1,052,076,900
住友ゴム工業	68,800	1,142.000	78,569,600
藤倉コンポジット	7,400	679.000	5,024,600
オカモト	4,700	3,950.000	18,565,000
ニッタ	7,700	2,697.000	20,766,900
住友理工	16,600	547.000	9,080,200
三ツ星ベルト	9,400	1,932.000	18,160,800
バンドー化学	13,500	816.000	11,016,000
日東紡績	11,700	2,433.000	28,466,100
AGC	70,200	4,860.000	341,172,000
日本電気硝子	31,000	2,603.000	80,693,000
オハラ	4,300	1,083.000	4,656,900
住友大阪セメント	14,600	3,800.000	55,480,000
太平洋セメント	43,600	2,043.000	89,074,800
日本ヒューム	12,500	682.000	8,525,000
日本コンクリート工業	22,900	301.000	6,892,900
三谷セキサン	3,700	5,300.000	19,610,000
アジアパイルホールディングス	17,100	421.000	7,199,100
東海カーボン	64,500	1,063.000	68,563,500
日本カーボン	4,000	4,115.000	16,460,000
東洋炭素	5,100	2,838.000	14,473,800
ノリタケカンパニーリミテド	4,400	4,005.000	17,622,000
TOTO	54,700	4,335.000	237,124,500
日本碍子	82,500	1,682.000	138,765,000
日本特殊陶業	58,300	1,940.000	113,102,000
MARUWA	2,600	14,380.000	37,388,000
品川リフラクトリーズ	2,000	3,560.000	7,120,000
黒崎播磨	1,600	4,000.000	6,400,000
ヨータイ	5,800	1,321.000	7,661,800
東京窯業	16,100	289.000	4,652,900
フジインコーポレーテッド	6,100	5,580.000	34,038,000
ニチアス	17,500	2,305.000	40,337,500
ニチハ	10,700	2,292.000	24,524,400
日本製鉄	339,000	2,012.500	682,237,500

神戸製鋼所	139,700	551.000	76,974,700
中山製鋼所	14,900	420.000	6,258,000
合同製鐵	5,500	1,284.000	7,062,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	204,000	1,560.000	318,240,000
東京製鐵	25,700	1,283.000	32,973,100
共英製鋼	9,100	1,306.000	11,884,600
大和工業	14,500	3,775.000	54,737,500
東京鐵鋼	4,900	1,263.000	6,188,700
大阪製鐵	4,800	1,431.000	6,868,800
淀川製鋼所	9,700	2,545.000	24,686,500
丸一鋼管	24,000	2,754.000	66,096,000
モリ工業	2,800	2,518.000	7,050,400
大同特殊鋼	12,500	3,435.000	42,937,500
日本冶金工業	5,700	2,482.000	14,147,400
山陽特殊製鋼	7,900	1,932.000	15,262,800
愛知製鋼	4,800	2,258.000	10,838,400
日立金属	81,600	1,965.000	160,344,000
大平洋金属	4,900	3,495.000	17,125,500
新日本電工	49,600	304.000	15,078,400
栗本鐵工所	5,000	1,588.000	7,940,000
三菱製鋼	6,300	1,029.000	6,482,700
日本精線	1,500	4,220.000	6,330,000
エンビプロ・ホールディングス	5,800	1,007.000	5,840,600
大紀アルミニウム工業所	11,300	1,429.000	16,147,700
日本輕金属ホールディングス	19,300	1,615.000	31,169,500
三井金属鋳業	20,200	3,190.000	64,438,000
東邦垂鉛	4,600	2,723.000	12,525,800
三菱マテリアル	50,000	1,999.000	99,950,000
住友金属鋳山	96,900	5,468.000	529,849,200
DOWAホールディングス	20,500	5,450.000	111,725,000
古河機械金属	12,500	1,250.000	15,625,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,000	1,332.000	14,652,000
東邦チタニウム	14,400	1,432.000	20,620,800
UACJ	11,300	2,106.000	23,797,800
CKサンエツ	1,900	4,100.000	7,790,000
古河電気工業	23,700	2,086.000	49,438,200
住友電気工業	283,500	1,366.500	387,402,750
フジクラ	84,100	561.000	47,180,100
昭和電線ホールディングス	6,900	1,673.000	11,543,700
タツタ電線	15,600	457.000	7,129,200
平河ヒューテック	5,400	1,074.000	5,799,600
リョービ	10,200	1,029.000	10,495,800
アサヒホールディングス	30,200	2,119.000	63,993,800
宮地エンジニアリンググループ	2,700	3,460.000	9,342,000
トーカロ	19,400	1,250.000	24,250,000
アルファ	5,600	947.000	5,303,200
SUMCO	116,600	1,913.000	223,055,800
川田テクノロジーズ	2,100	3,520.000	7,392,000

RS TECHNOLOGIES	2,500	5,770.000	14,425,000
東洋製罐グループホールディングス	48,600	1,400.000	68,040,000
ホッカホールディングス	6,300	1,264.000	7,963,200
横河ブリッジホールディングス	12,900	1,852.000	23,890,800
駒井ハルテック	2,100	1,951.000	4,097,100
三和ホールディングス	71,500	1,142.000	81,653,000
文化シャッター	24,200	947.000	22,917,400
三協立山	12,000	586.000	7,032,000
アルインコ	8,600	846.000	7,275,600
LIXIL	119,200	2,241.000	267,127,200
ノーリツ	14,600	1,481.000	21,622,600
長府製作所	8,400	1,847.000	15,514,800
リンナイ	14,300	8,180.000	116,974,000
日東精工	13,000	497.000	6,461,000
岡部	17,100	665.000	11,371,500
ジーテクト	9,300	1,259.000	11,708,700
東プレ	14,200	1,085.000	15,407,000
高周波熱錬	15,700	574.000	9,011,800
東京製綱	6,500	835.000	5,427,500
サンコール	9,900	489.000	4,841,100
パイオラックス	11,000	1,499.000	16,489,000
エイチワン	10,100	583.000	5,888,300
日本発条	70,200	827.000	58,055,400
立川ブラインド工業	5,000	1,058.000	5,290,000
三益半導体工業	5,800	2,294.000	13,305,200
日本製鋼所	23,100	3,505.000	80,965,500
三浦工業	32,900	2,677.000	88,073,300
タクマ	25,700	1,400.000	35,980,000
ツガミ	17,400	1,185.000	20,619,000
オークマ	8,700	4,570.000	39,759,000
芝浦機械	8,600	3,075.000	26,445,000
アマダ	118,500	995.000	117,907,500
アイダエンジニアリング	19,700	949.000	18,695,300
FUJII	34,700	2,135.000	74,084,500
牧野フライス製作所	8,100	3,875.000	31,387,500
オーエスジー	35,400	1,585.000	56,109,000
旭ダイヤモンド工業	21,700	558.000	12,108,600
D M G 森精機	44,700	1,603.000	71,654,100
ソディック	17,300	702.000	12,144,600
ディスコ	11,200	32,100.000	359,520,000
日東工器	5,300	1,451.000	7,690,300
日進工具	6,500	1,388.000	9,022,000
石川製作所	2,500	1,331.000	3,327,500
島精機製作所	11,400	1,773.000	20,212,200
オプトラン	9,700	1,900.000	18,430,000
N C ホールディングス	3,000	1,675.000	5,025,000
フリュー	7,400	1,027.000	7,599,800
ヤマシンフィルタ	18,900	351.000	6,633,900

日阪製作所	11,600	766.000	8,885,600
やまびこ	14,700	1,375.000	20,212,500
野村マイクロ・サイエンス	2,200	3,545.000	7,799,000
平田機工	3,600	4,715.000	16,974,000
マルマエ	3,500	2,167.000	7,584,500
タツモ	4,500	1,470.000	6,615,000
ナブテスコ	43,200	3,040.000	131,328,000
三井海洋開発	8,800	1,174.000	10,331,200
レオン自動機	9,400	1,041.000	9,785,400
S M C	22,500	63,580.000	1,430,550,000
ホソカワミクロン	5,400	2,404.000	12,981,600
ユニオンツール	3,000	3,625.000	10,875,000
オイレス工業	10,500	1,466.000	15,393,000
日精エー・エス・ビー機械	2,900	2,946.000	8,543,400
サトーホールディングス	10,100	1,733.000	17,503,300
技研製作所	6,700	3,435.000	23,014,500
日本エアーテック	4,900	1,031.000	5,051,900
日精樹脂工業	6,900	944.000	6,513,600
ワイエイシイホールディングス	3,900	1,570.000	6,123,000
小松製作所	347,500	2,928.000	1,017,480,000
住友重機械工業	43,600	2,660.000	115,976,000
日立建機	30,700	3,135.000	96,244,500
日工	14,300	601.000	8,594,300
巴工業	3,800	2,275.000	8,645,000
井関農機	7,900	1,198.000	9,464,200
T O W A	6,700	2,085.000	13,969,500
北川鉄工所	4,900	1,252.000	6,134,800
ローツェ	3,800	11,450.000	43,510,000
クボタ	371,200	2,170.500	805,689,600
荏原実業	4,000	2,304.000	9,216,000
三菱化工機	3,200	1,902.000	6,086,400
月島機械	14,300	1,003.000	14,342,900
帝国電機製作所	6,200	1,610.000	9,982,000
新東工業	18,900	678.000	12,814,200
澁谷工業	6,700	2,289.000	15,336,300
アイチコーポレーション	12,200	865.000	10,553,000
小森コーポレーション	21,000	708.000	14,868,000
鶴見製作所	6,600	1,848.000	12,196,800
荏原製作所	31,400	5,950.000	186,830,000
西島製作所	10,000	1,264.000	12,640,000
北越工業	9,300	837.000	7,784,100
ダイキン工業	97,700	20,200.000	1,973,540,000
オルガノ	2,100	8,790.000	18,459,000
トーヨーカネツ	3,500	2,372.000	8,302,000
栗田工業	41,500	4,325.000	179,487,500
椿本チエイン	9,600	2,895.000	27,792,000
大同工業	5,300	895.000	4,743,500
木村化工機	7,500	806.000	6,045,000

アネスト岩田	13,800	807.000	11,136,600
ダイフク	42,100	8,010.000	337,221,000
サムコ	2,400	2,417.000	5,800,800
タダノ	41,200	909.000	37,450,800
フジテック	28,600	2,815.000	80,509,000
C K D	22,300	1,672.000	37,285,600
キトー	7,200	1,649.000	11,872,800
平和	21,500	1,910.000	41,065,000
理想科学工業	6,700	2,251.000	15,081,700
S A N K Y O	16,700	3,700.000	61,790,000
日本金銭機械	10,800	704.000	7,603,200
マースグループホールディングス	6,400	1,706.000	10,918,400
フクシマガリレイ	5,300	3,700.000	19,610,000
ダイコク電機	5,600	1,244.000	6,966,400
竹内製作所	11,400	2,312.000	26,356,800
アマノ	20,400	2,183.000	44,533,200
J U K I	11,800	817.000	9,640,600
ジャノメ	8,100	672.000	5,443,200
マックス	10,300	1,533.000	15,789,900
グローリー	19,800	2,052.000	40,629,600
新晃工業	7,300	1,586.000	11,577,800
大和冷機工業	11,000	1,086.000	11,946,000
セガサミーホールディングス	76,200	2,220.000	169,164,000
日本ピストンリング	4,400	1,260.000	5,544,000
リケン	3,800	2,364.000	8,983,200
T P R	10,200	1,233.000	12,576,600
ツバキ・ナカシマ	17,100	929.000	15,885,900
ホシザキ	22,400	7,990.000	178,976,000
大豊工業	8,200	639.000	5,239,800
日本精工	144,000	709.000	102,096,000
N T N	163,900	205.000	33,599,500
ジェイテクト	72,800	882.000	64,209,600
不二越	6,300	3,665.000	23,089,500
日本トムソン	22,700	498.000	11,304,600
T H K	43,300	2,538.000	109,895,400
ユーシン精機	9,000	630.000	5,670,000
前澤給装工業	7,800	932.000	7,269,600
イーグル工業	10,500	991.000	10,405,500
日本ピラー工業	7,700	2,583.000	19,889,100
キッツ	26,500	641.000	16,986,500
マキタ	93,300	3,723.000	347,355,900
日立造船	64,800	685.000	44,388,000
三菱重工業	120,200	4,293.000	516,018,600
I H I	47,800	2,937.000	140,388,600
スター精密	11,800	1,412.000	16,661,600
日清紡ホールディングス	47,100	950.000	44,745,000
イビデン	40,200	5,280.000	212,256,000
コニカミノルタ	168,500	485.000	81,722,500

ブラザー工業	93,500	2,212.000	206,822,000
ミネベアミツミ	131,600	2,538.000	334,000,800
日立製作所	368,800	5,908.000	2,178,870,400
東芝	133,900	5,342.000	715,293,800
三菱電機	766,800	1,354.000	1,038,247,200
富士電機	46,100	5,620.000	259,082,000
安川電機	82,400	4,460.000	367,504,000
シンフォニア テクノロジー	10,400	1,245.000	12,948,000
明電舎	13,100	2,315.000	30,326,500
オリジン	4,700	1,386.000	6,514,200
山洋電気	3,500	4,530.000	15,855,000
デンヨー	7,600	1,605.000	12,198,000
PHCホールディングス	9,000	1,828.000	16,452,000
東芝テック	8,300	4,440.000	36,852,000
芝浦メカトロニクス	1,400	7,330.000	10,262,000
マブチモーター	17,800	3,580.000	63,724,000
日本電産	198,600	8,371.000	1,662,480,600
トレックス・セミコンダクター	4,200	2,279.000	9,571,800
東光高岳	5,200	1,547.000	8,044,400
ダイヘン	8,200	3,610.000	29,602,000
ヤーマン	13,500	1,180.000	15,930,000
JVCケンウッド	67,700	184.000	12,456,800
ミマキエンジニアリング	9,300	649.000	6,035,700
I - P E X	4,300	1,393.000	5,989,900
日新電機	17,800	1,348.000	23,994,400
大崎電気工業	19,000	490.000	9,310,000
オムロン	63,800	7,646.000	487,814,800
日東工業	10,100	1,495.000	15,099,500
I D E C	9,800	2,230.000	21,854,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	25,200	2,221.000	55,969,200
メルコホールディングス	2,000	3,800.000	7,600,000
日本電気	97,400	5,150.000	501,610,000
富士通	69,000	19,110.000	1,318,590,000
沖電気工業	31,300	832.000	26,041,600
電気興業	4,700	2,358.000	11,082,600
サンケン電気	7,300	4,825.000	35,222,500
アイホン	5,000	1,987.000	9,935,000
ルネサスエレクトロニクス	416,000	1,359.000	565,344,000
セイコーエプソン	95,100	1,791.000	170,324,100
ワコム	59,400	919.000	54,588,600
アルバック	15,300	5,070.000	77,571,000
アクセル	4,300	954.000	4,102,200
E I Z O	6,000	3,320.000	19,920,000
日本信号	20,100	910.000	18,291,000
京三製作所	20,100	429.000	8,622,900
能美防災	10,300	1,890.000	19,467,000
ホーチキ	6,900	1,181.000	8,148,900
エレコム	17,600	1,498.000	26,364,800



パナソニック ホールディングス	818,100	1,141.500	933,861,150
シャープ	87,300	1,095.000	95,593,500
アンリツ	49,800	1,620.000	80,676,000
富士通ゼネラル	21,300	2,335.000	49,735,500
ソニーグループ	480,200	11,070.000	5,315,814,000
T D K	110,900	3,945.000	437,500,500
帝国通信工業	5,000	1,400.000	7,000,000
タムラ製作所	30,100	554.000	16,675,400
アルプスアルパイン	68,600	1,168.000	80,124,800
日本電波工業	7,700	1,178.000	9,070,600
メイコー	6,200	3,395.000	21,049,000
日本トリム	2,200	2,335.000	5,137,000
ローランド ディー . ジー .	4,800	3,250.000	15,600,000
フォスター電機	10,300	679.000	6,993,700
S M K	2,600	2,115.000	5,499,000
ヨコオ	5,700	2,404.000	13,702,800
ホシデン	18,300	1,213.000	22,197,900
ヒロセ電機	11,800	16,190.000	191,042,000
日本航空電子工業	17,500	1,990.000	34,825,000
T O A	10,500	684.000	7,182,000
マクセル	15,400	1,140.000	17,556,000
古野電気	10,400	919.000	9,557,600
ユニデンホールディングス	2,200	3,435.000	7,557,000
スミダコーポレーション	8,100	832.000	6,739,200
アイコム	3,700	2,339.000	8,654,300
リオン	3,600	2,205.000	7,938,000
横河電機	76,700	2,077.000	159,305,900
新電元工業	3,200	2,879.000	9,212,800
アズビル	45,000	3,900.000	175,500,000
東亜ディーケーケー	6,100	880.000	5,368,000
日本光電工業	32,000	3,090.000	98,880,000
共和電業	17,600	347.000	6,107,200
日本電子材料	4,400	1,996.000	8,782,400
堀場製作所	14,200	6,140.000	87,188,000
アドバンテスト	56,900	8,520.000	484,788,000
エスペック	6,500	1,671.000	10,861,500
キーエンス	69,500	50,590.000	3,516,005,000
日置電機	3,700	7,690.000	28,453,000
シスメックス	64,800	8,715.000	564,732,000
日本マイクロニクス	13,500	1,513.000	20,425,500
メガチップス	7,200	3,325.000	23,940,000
O B A R A G R O U P	3,900	2,845.000	11,095,500
コーセル	11,000	741.000	8,151,000
イリソ電子工業	6,600	2,991.000	19,740,600
オプテックスグループ	12,900	1,673.000	21,581,700
千代田インテグレ	4,200	2,131.000	8,950,200
レーザーテック	33,700	18,035.000	607,779,500
スタンレー電気	53,400	2,159.000	115,290,600

岩崎電気	3,600	2,314.000	8,330,400
ウシオ電機	39,700	1,682.000	66,775,400
日本セラミック	7,400	2,320.000	17,168,000
遠藤照明	5,300	868.000	4,600,400
古河電池	6,000	1,180.000	7,080,000
山一電機	6,100	1,638.000	9,991,800
図研	5,200	2,925.000	15,210,000
日本電子	16,000	5,950.000	95,200,000
カシオ計算機	55,900	1,336.000	74,682,400
ファナック	67,300	20,710.000	1,393,783,000
日本シイエムケイ	17,100	521.000	8,909,100
エンプラス	2,400	2,703.000	6,487,200
大真空	11,000	1,181.000	12,991,000
ローム	34,300	9,120.000	312,816,000
浜松ホトニクス	54,900	5,730.000	314,577,000
三井ハイテック	7,500	11,060.000	82,950,000
新光電気工業	22,500	5,750.000	129,375,000
京セラ	107,900	6,753.000	728,648,700
太陽誘電	37,100	5,140.000	190,694,000
村田製作所	225,200	7,725.000	1,739,670,000
双葉電子工業	17,500	670.000	11,725,000
北陸電気工業	4,700	1,122.000	5,273,400
ニチコン	24,200	1,159.000	28,047,800
日本ケミコン	7,700	1,757.000	13,528,900
K O A	11,800	1,412.000	16,661,600
市光工業	11,300	369.000	4,169,700
小糸製作所	41,900	4,620.000	193,578,000
ミツバ	16,500	338.000	5,577,000
S C R E E Nホールディングス	13,300	10,700.000	142,310,000
キヤノン電子	7,800	1,473.000	11,489,400
キヤノン	380,800	2,947.000	1,122,217,600
リコー	213,200	920.000	196,144,000
象印マホービン	21,000	1,338.000	28,098,000
東京エレクトロン	48,600	55,630.000	2,703,618,000
トヨタ紡織	31,300	1,885.000	59,000,500
ユニプレス	13,800	729.000	10,060,200
豊田自動織機	61,800	7,700.000	475,860,000
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	699.000	7,898,700
デンソー	168,900	7,374.000	1,245,468,600
東海理化電機製作所	19,300	1,442.000	27,830,600
川崎重工業	55,900	2,277.000	127,284,300
日本車輛製造	3,700	2,085.000	7,714,500
三菱ロジスネクスト	10,900	737.000	8,033,300
日産自動車	905,100	509.300	460,967,430
いすゞ自動車	240,200	1,529.000	367,265,800
トヨタ自動車	3,883,000	2,180.000	8,464,940,000
日野自動車	96,000	685.000	65,760,000

三菱自動車工業	284,500	308.000	87,626,000
武蔵精密工業	17,100	1,324.000	22,640,400
日産車体	13,500	553.000	7,465,500
新明和工業	21,700	895.000	19,421,500
極東開発工業	14,300	1,273.000	18,203,900
トピー工業	8,300	1,001.000	8,308,300
ティラド	2,700	2,248.000	6,069,600
曙ブレーキ工業	50,300	149.000	7,494,700
タチエス	14,400	990.000	14,256,000
N O K	37,800	1,086.000	41,050,800
フタバ産業	21,800	328.000	7,150,400
K Y B	7,800	2,855.000	22,269,000
大同メタル工業	18,700	547.000	10,228,900
プレス工業	39,700	366.000	14,530,200
ミクニ	12,800	377.000	4,825,600
太平洋工業	16,300	875.000	14,262,500
アイシン	55,800	3,865.000	215,667,000
マツダ	240,500	901.000	216,690,500
本田技研工業	603,900	3,399.000	2,052,656,100
スズキ	175,500	4,008.000	703,404,000
S U B A R U	219,900	1,946.000	427,925,400
安永	5,900	724.000	4,271,600
ヤマハ発動機	99,600	2,694.000	268,322,400
T B K	17,300	346.000	5,985,800
エクセディ	11,400	1,513.000	17,248,200
豊田合成	24,900	1,818.000	45,268,200
愛三工業	13,700	665.000	9,110,500
ヨロズ	9,300	778.000	7,235,400
エフ・シー・シー	12,300	1,263.000	15,534,900
シマノ	30,700	25,900.000	795,130,000
テイ・エス テック	32,700	1,333.000	43,589,100
ジャムコ	5,500	789.000	4,339,500
テルモ	217,100	3,880.000	842,348,000
日機装	23,200	794.000	18,420,800
日本エム・ディ・エム	5,100	1,567.000	7,991,700
島津製作所	98,400	4,215.000	414,756,000
J M S	9,600	580.000	5,568,000
長野計器	6,200	1,088.000	6,745,600
ブイ・テクノロジ	3,500	2,951.000	10,328,500
東京計器	6,800	1,108.000	7,534,400
インターアクション	4,100	1,873.000	7,679,300
東京精密	12,800	4,410.000	56,448,000
マニー	31,300	1,503.000	47,043,900
ニコン	117,200	1,457.000	170,760,400
トプコン	36,500	1,671.000	60,991,500
オリンパス	402,400	2,370.000	953,688,000
理研計器	6,200	4,130.000	25,606,000
タムロン	5,900	2,239.000	13,210,100

HOYA	149,600	12,845.000	1,921,612,000
ノーリツ鋼機	7,100	2,147.000	15,243,700
A & D ホロンホールディングス	7,600	880.000	6,688,000
朝日インテック	84,300	2,579.000	217,409,700
シチズン時計	88,800	481.000	42,712,800
リズム	3,800	1,642.000	6,239,600
メニコン	25,700	2,742.000	70,469,400
松風	4,100	1,603.000	6,572,300
セイコーホールディングス	10,700	2,141.000	22,908,700
ニプロ	58,200	1,008.000	58,665,600
スノーピーク	9,900	2,611.000	25,848,900
パラマウントベッドホールディングス	14,700	2,103.000	30,914,100
トランザクション	5,700	1,013.000	5,774,100
ニホンフラッシュ	7,600	955.000	7,258,000
前田工織	8,500	2,852.000	24,242,000
永大産業	20,600	286.000	5,891,600
アートネイチャー	9,300	704.000	6,547,200
バンダイナムコホールディングス	68,600	8,873.000	608,687,800
SHOEI	7,200	4,840.000	34,848,000
フランスベッドホールディングス	12,700	866.000	10,998,200
パイロットコーポレーション	13,100	5,220.000	68,382,000
萩原工業	6,600	1,046.000	6,903,600
フジシールインターナショナル	18,700	1,701.000	31,808,700
タカラトミー	31,800	1,218.000	38,732,400
広済堂ホールディングス	6,500	786.000	5,109,000
プロネクサス	7,800	1,018.000	7,940,400
大建工業	4,900	2,081.000	10,196,900
凸版印刷	116,100	2,127.000	246,944,700
大日本印刷	90,300	2,675.000	241,552,500
共同印刷	3,000	2,717.000	8,151,000
NISSHA	15,900	1,377.000	21,894,300
TAKARA & COMPANY	5,700	1,858.000	10,590,600
アシックス	67,900	2,134.000	144,898,600
ローランド	5,500	4,425.000	24,337,500
ヤマハ	44,400	5,110.000	226,884,000
河合楽器製作所	2,500	2,942.000	7,355,000
ピジョン	45,600	2,057.000	93,799,200
キングジム	9,600	942.000	9,043,200
リンテック	16,700	2,386.000	39,846,200
イトーキ	20,200	339.000	6,847,800
任天堂	43,300	61,400.000	2,658,620,000
三菱鉛筆	12,700	1,234.000	15,671,800
タカラスタダード	15,700	1,285.000	20,174,500
コクヨ	37,400	1,675.000	62,645,000
ナカバヤシ	11,400	488.000	5,563,200
グローブライド	6,900	2,645.000	18,250,500
オカムラ	26,300	1,178.000	30,981,400
美津濃	7,800	2,095.000	16,341,000

東京電力ホールディングス	573,900	454.000	260,550,600
中部電力	232,900	1,311.000	305,331,900
関西電力	289,200	1,203.000	347,907,600
中国電力	118,400	860.000	101,824,000
北陸電力	72,100	536.000	38,645,600
東北電力	178,000	726.000	129,228,000
四国電力	69,300	760.000	52,668,000
九州電力	156,300	824.000	128,791,200
北海道電力	67,700	491.000	33,240,700
沖縄電力	16,300	1,292.000	21,059,600
電源開発	65,400	1,787.000	116,869,800
エフオン	7,600	538.000	4,088,800
イーレックス	11,600	1,905.000	22,098,000
レノバ	15,200	1,526.000	23,195,200
東京瓦斯	146,500	2,293.000	335,924,500
大阪瓦斯	137,900	2,130.000	293,727,000
東邦瓦斯	34,900	2,532.000	88,366,800
北海道瓦斯	5,600	1,482.000	8,299,200
広島ガス	20,900	313.000	6,541,700
西部ガスホールディングス	8,900	1,939.000	17,257,100
静岡ガス	19,700	879.000	17,316,300
メタウォーター	8,500	1,948.000	16,558,000
SBSホールディングス	5,500	3,010.000	16,555,000
東武鉄道	74,300	2,982.000	221,562,600
相鉄ホールディングス	25,000	2,297.000	57,425,000
東急	192,200	1,617.000	310,787,400
京浜急行電鉄	98,600	1,316.000	129,757,600
小田急電鉄	113,800	2,036.000	231,696,800
京王電鉄	39,700	5,020.000	199,294,000
京成電鉄	53,300	3,395.000	180,953,500
富士急行	9,200	4,040.000	37,168,000
新京成電鉄	3,800	2,248.000	8,542,400
東日本旅客鉄道	134,900	6,878.000	927,842,200
西日本旅客鉄道	92,900	4,987.000	463,292,300
東海旅客鉄道	63,800	16,250.000	1,036,750,000
西武ホールディングス	100,200	1,309.000	131,161,800
鴻池運輸	12,300	1,125.000	13,837,500
西日本鉄道	21,500	2,631.000	56,566,500
ハマキョウレックス	5,400	2,840.000	15,336,000
サカイ引越センター	3,400	4,345.000	14,773,000
近鉄グループホールディングス	72,100	3,740.000	269,654,000
阪急阪神ホールディングス	90,200	3,475.000	313,445,000
南海電気鉄道	32,600	2,374.000	77,392,400
京阪ホールディングス	32,400	2,841.000	92,048,400
神戸電鉄	2,800	3,215.000	9,002,000
名古屋鉄道	59,800	2,088.000	124,862,400
山陽電気鉄道	6,700	2,027.000	13,580,900
アルプス物流	5,700	1,032.000	5,882,400

ヤマトホールディングス	101,700	2,431.000	247,232,700
山九	19,000	3,925.000	74,575,000
丸全昭和運輸	6,000	3,135.000	18,810,000
センコーグループホールディングス	35,000	868.000	30,380,000
トナミホールディングス	2,000	3,750.000	7,500,000
ニッコンホールディングス	24,600	1,899.000	46,715,400
福山通運	11,700	3,600.000	42,120,000
セイノーホールディングス	49,200	1,042.000	51,266,400
神奈川中央交通	2,600	3,250.000	8,450,000
日立物流	14,000	8,330.000	116,620,000
丸和運輸機関	15,400	1,471.000	22,653,400
C & F ロジホールディングス	7,800	1,108.000	8,642,400
九州旅客鉄道	56,300	2,571.000	144,747,300
S Gホールディングス	137,000	2,267.000	310,579,000
NIPPON EXPRESSホールディングス	24,900	7,440.000	185,256,000
日本郵船	60,600	9,310.000	564,186,000
商船三井	120,300	3,010.000	362,103,000
川崎汽船	22,300	6,810.000	151,863,000
NSユナイテッド海運	4,100	3,710.000	15,211,000
明治海運	10,400	730.000	7,592,000
飯野海運	35,200	743.000	26,153,600
乾汽船	5,500	1,665.000	9,157,500
日本航空	166,300	2,173.000	361,369,900
ANAホールディングス	185,300	2,433.000	450,834,900
トランコム	2,100	6,920.000	14,532,000
日新	6,400	1,540.000	9,856,000
三菱倉庫	22,900	2,999.000	68,677,100
三井倉庫ホールディングス	7,600	2,354.000	17,890,400
住友倉庫	24,900	2,156.000	53,684,400
澁澤倉庫	4,900	2,271.000	11,127,900
東陽倉庫	21,100	308.000	6,498,800
日本トランスシティ	17,000	590.000	10,030,000
川西倉庫	3,800	1,100.000	4,180,000
安田倉庫	8,500	978.000	8,313,000
東洋埠頭	5,400	1,468.000	7,927,200
上組	39,200	2,195.000	86,044,000
近鉄エクスプレス	13,500	3,100.000	41,850,000
エーアイティー	5,500	1,527.000	8,398,500
内外トランスライン	3,500	1,775.000	6,212,500
日本コンセプト	3,600	1,316.000	4,737,600
NEC ネットスアイ	24,400	1,754.000	42,797,600
クロスキャット	5,400	954.000	5,151,600
システナ	105,700	403.000	42,597,100
デジタルアーツ	4,100	7,520.000	30,832,000
日鉄ソリューションズ	10,700	3,880.000	41,516,000
コア	4,100	1,570.000	6,437,000
手間いらず	1,300	4,695.000	6,103,500

ラクーンホールディングス	7,300	1,417.000	10,344,100
ソリトンシステムズ	4,900	1,488.000	7,291,200
ソフトクリエイティブホールディングス	3,500	4,085.000	14,297,500
T I S	71,600	2,872.000	205,635,200
グリー	34,900	1,056.000	36,854,400
コーエーテクモホールディングス	24,100	3,920.000	94,472,000
三菱総合研究所	3,100	3,810.000	11,811,000
ファインデックス	8,000	649.000	5,192,000
ブレインパッド	7,100	1,129.000	8,015,900
K L a b	16,500	459.000	7,573,500
ポルトゥウィンホールディングス	11,800	977.000	11,528,600
ネクソン	169,900	2,932.000	498,146,800
エムアップホールディングス	9,400	1,025.000	9,635,000
エイチーム	7,100	741.000	5,261,100
エニグモ	9,500	525.000	4,987,500
コロブラ	25,300	646.000	16,343,800
ブロードリーフ	38,900	366.000	14,237,400
デジタルハーツホールディングス	4,200	1,781.000	7,480,200
システム情報	6,700	943.000	6,318,100
メディアドゥ	3,000	1,773.000	5,319,000
じげん	26,100	307.000	8,012,700
ブイキューブ	8,800	956.000	8,412,800
フィックスターズ	10,400	826.000	8,590,400
C A R T A H O L D I N G S	3,700	2,436.000	9,013,200
オブティム	6,700	885.000	5,929,500
セレス	3,300	1,500.000	4,950,000
S H I F T	3,800	24,760.000	94,088,000
ティーガイア	7,000	1,618.000	11,326,000
テクマトリックス	13,000	2,058.000	26,754,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	19,800	2,628.000	52,034,400
G M O ペイメントゲートウェイ	14,600	10,960.000	160,016,000
システムリサーチ	3,100	1,907.000	5,911,700
インターネットイニシアティブ	20,200	4,005.000	80,901,000
さくらインターネット	11,000	536.000	5,896,000
G M O グローバルサイン・ホールディングス	1,900	5,590.000	10,621,000
S R A ホールディングス	4,200	2,761.000	11,596,200
e B A S E	11,200	440.000	4,928,000
アバント	8,700	1,150.000	10,005,000
アドソル日進	3,800	1,545.000	5,871,000
フリービット	5,700	849.000	4,839,300
コムチュア	8,400	2,835.000	23,814,000
アステリア	6,500	978.000	6,357,000
アイル	4,600	1,350.000	6,210,000
マークライNZ	4,300	2,618.000	11,257,400
メディカル・データ・ビジョン	10,500	1,025.000	10,762,500
g u m i	12,200	564.000	6,880,800

テラスカイ	3,500	1,364.000	4,774,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	4,400	1,190.000	5,236,000
P C Iホールディングス	4,900	988.000	4,841,200
パイブドHD	1,900	2,365.000	4,493,500
P R T I M E S	1,800	2,173.000	3,911,400
ラクス	26,200	1,695.000	44,409,000
ダブルスタンダード	2,700	1,861.000	5,024,700
オープンドア	5,100	2,006.000	10,230,600
アカツキ	3,600	3,020.000	10,872,000
U B I C O Mホールディングス	2,500	2,805.000	7,012,500
カナミックネットワーク	12,100	489.000	5,916,900
チェンジ	13,900	1,839.000	25,562,100
オークネット	5,000	1,539.000	7,695,000
マクロミル	17,200	1,212.000	20,846,400
オロ	2,800	2,021.000	5,658,800
ユーザーローカル	3,400	1,749.000	5,946,600
マネーフォワード	11,500	4,525.000	52,037,500
電算システムホールディングス	3,300	2,538.000	8,375,400
プロトコーポレーション	8,800	1,000.000	8,800,000
野村総合研究所	145,200	4,045.000	587,334,000
日本システム技術	2,000	2,479.000	4,958,000
インテージホールディングス	9,200	1,585.000	14,582,000
ソースネクスト	39,100	189.000	7,389,900
インフォコム	8,400	2,190.000	18,396,000
シンプレクス・ホールディングス	8,800	1,729.000	15,215,200
H E R O Z	2,600	961.000	2,498,600
ラクスル	8,500	2,812.000	23,902,000
I P S	2,700	2,076.000	5,605,200
イーソル	6,700	636.000	4,261,200
アルテリア・ネットワークス	10,100	1,316.000	13,291,600
ウイングアーク1 s t	5,200	1,263.000	6,567,600
サーバーワークス	1,600	1,979.000	3,166,400
S a n s a n	27,200	1,348.000	36,665,600
ギフティ	7,900	1,112.000	8,784,800
ベース	1,600	6,220.000	9,952,000
J M D C	7,100	6,560.000	46,576,000
フォーカスシステムズ	6,800	903.000	6,140,400
クレスコ	6,100	1,833.000	11,181,300
フジ・メディア・ホールディングス	71,700	1,110.000	79,587,000
オービック	23,700	18,820.000	446,034,000
ジャストシステム	10,700	5,530.000	59,171,000
T D Cソフト	7,800	1,119.000	8,728,200
Zホールディングス	1,082,700	519.200	562,137,840
トレンドマイクロ	40,200	7,110.000	285,822,000
日本オラクル	12,200	8,510.000	103,822,000
アルファシステムズ	2,300	3,625.000	8,337,500
フューチャー	15,700	1,498.000	23,518,600



CAC HOLDINGS	5,400	1,365.000	7,371,000
S Bテクノロジー	3,700	2,517.000	9,312,900
オービックビジネスコンサルタント	7,100	4,765.000	33,831,500
伊藤忠テクノソリューションズ	34,200	3,060.000	104,652,000
アイティフォー	10,900	801.000	8,730,900
東計電算	1,200	5,260.000	6,312,000
大塚商会	40,700	4,255.000	173,178,500
サイボウズ	10,700	1,294.000	13,845,800
電通国際情報サービス	10,700	3,735.000	39,964,500
ACCESS	11,400	562.000	6,406,800
デジタルガレージ	12,400	4,320.000	53,568,000
イーエムシステムズ	14,800	865.000	12,802,000
ウェザーニューズ	2,600	7,000.000	18,200,000
C I J	8,700	752.000	6,542,400
WOWOW	4,200	1,483.000	6,228,600
スカラ	9,600	744.000	7,142,400
IMAGICA GROUP	8,000	706.000	5,648,000
ネットワンシステムズ	28,800	3,110.000	89,568,000
アルゴグラフィックス	6,000	2,955.000	17,730,000
マーベラス	14,300	750.000	10,725,000
エイベックス	13,500	1,414.000	19,089,000
B I P R O G Y	23,600	3,240.000	76,464,000
兼松エレクトロニクス	4,100	3,785.000	15,518,500
都築電気	4,500	1,469.000	6,610,500
T B Sホールディングス	45,900	1,704.000	78,213,600
日本テレビホールディングス	63,100	1,232.000	77,739,200
朝日放送グループホールディングス	9,800	707.000	6,928,600
テレビ朝日ホールディングス	18,200	1,460.000	26,572,000
スカパーJ S A Tホールディングス	63,100	405.000	25,555,500
テレビ東京ホールディングス	5,900	2,010.000	11,859,000
ビジョン	13,600	1,285.000	17,476,000
USEN - N E X T H O L D I N G S	7,300	2,185.000	15,950,500
コネクシオ	6,000	1,376.000	8,256,000
日本通信	68,900	186.000	12,815,400
日本電信電話	786,800	3,763.000	2,960,728,400
K D D I	548,400	4,269.000	2,341,119,600
ソフトバンク	1,138,800	1,480.500	1,685,993,400
光通信	8,700	14,760.000	128,412,000
エムティーアイ	10,700	484.000	5,178,800
G M Oインターネット	26,800	2,576.000	69,036,800
ファイバーゲート	4,600	1,157.000	5,322,200
K A D O K A W A	41,000	3,185.000	130,585,000
学研ホールディングス	11,100	852.000	9,457,200
ゼンリン	13,600	920.000	12,512,000
アイネット	5,700	1,219.000	6,948,300
松竹	5,100	12,980.000	66,198,000
東宝	44,400	4,750.000	210,900,000
東映	2,500	17,010.000	42,525,000

エヌ・ティ・ティ・データ	199,500	2,385.000	475,807,500
ピー・シー・エー	5,100	1,505.000	7,675,500
ビジネスブレイン太田昭和	3,400	1,380.000	4,692,000
D T S	13,600	2,789.000	37,930,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	35,100	5,130.000	180,063,000
シーイーシー	9,000	1,177.000	10,593,000
カプコン	71,000	3,145.000	223,295,000
アイ・エス・ビー	4,700	1,100.000	5,170,000
ジャステック	5,900	1,117.000	6,590,300
S C S K	51,800	2,072.000	107,329,600
日本システムウエア	3,300	2,269.000	7,487,700
アイネス	7,800	1,461.000	11,395,800
T K C	12,400	3,340.000	41,416,000
富士ソフト	7,900	6,830.000	53,957,000
N S D	23,500	2,265.000	53,227,500
コナミホールディングス	27,300	8,060.000	220,038,000
福井コンピュータホールディングス	3,900	3,165.000	12,343,500
J B C Cホールディングス	5,900	1,450.000	8,555,000
ミロク情報サービス	7,900	1,292.000	10,206,800
ソフトバンクグループ	451,000	5,195.000	2,342,945,000
高千穂交易	3,900	1,494.000	5,826,600
伊藤忠食品	2,100	4,965.000	10,426,500
エレマテック	7,200	1,167.000	8,402,400
あらた	6,000	3,410.000	20,460,000
トーマンデバイス	1,200	5,940.000	7,128,000
東京エレクトロン デバイス	2,300	4,955.000	11,396,500
フィールズ	8,000	865.000	6,920,000
双日	83,100	1,942.000	161,380,200
アルフレッサ ホールディングス	84,100	1,740.000	146,334,000
横浜冷凍	22,900	861.000	19,716,900
アルコニックス	10,000	1,364.000	13,640,000
神戸物産	58,700	3,300.000	193,710,000
あい ホールディングス	11,000	1,675.000	18,425,000
ダイワボウホールディングス	36,900	1,577.000	58,191,300
マクニカ・富士エレホールディングス	17,700	2,583.000	45,719,100
ラクト・ジャパン	3,200	1,993.000	6,377,600
グリムス	3,700	1,586.000	5,868,200
バイタルケーエスケー・ホールディングス	15,500	768.000	11,904,000
八洲電機	8,400	924.000	7,761,600
レスターホールディングス	7,100	1,983.000	14,079,300
ジュテックホールディングス	3,000	1,123.000	3,369,000
T O K A Iホールディングス	35,900	860.000	30,874,000
三洋貿易	8,900	962.000	8,561,800
ビューティガレージ	1,600	2,815.000	4,504,000
ウイン・パートナーズ	6,000	970.000	5,820,000
シップヘルスケアホールディングス	24,700	2,143.000	52,932,100

コメダホールディングス	17,200	2,208.000	37,977,600
フルサト・マルカホールディングス	7,500	3,285.000	24,637,500
ヤマエグループホールディングス	6,200	1,039.000	6,441,800
小野建	7,700	1,498.000	11,534,600
佐島電機	6,400	1,196.000	7,654,400
伯東	4,800	2,286.000	10,972,800
コンドーテック	7,600	1,055.000	8,018,000
ナガイレーベン	10,500	1,885.000	19,792,500
三菱食品	7,000	3,135.000	21,945,000
松田産業	5,800	2,226.000	12,910,800
第一興商	14,800	3,465.000	51,282,000
メディパルホールディングス	81,300	2,044.000	166,177,200
S P K	5,300	1,306.000	6,921,800
萩原電気ホールディングス	3,700	1,882.000	6,963,400
アズワン	11,000	6,800.000	74,800,000
尾家産業	5,000	943.000	4,715,000
シモジマ	6,500	906.000	5,889,000
ドウシシャ	7,600	1,491.000	11,331,600
高速	5,500	1,464.000	8,052,000
丸文	8,900	663.000	5,900,700
ハピネット	7,100	1,495.000	10,614,500
日本ライフライン	22,900	1,079.000	24,709,100
タカショー	8,400	697.000	5,854,800
I D O M	23,800	611.000	14,541,800
進和	5,200	1,950.000	10,140,000
ダイトロン	3,800	1,808.000	6,870,400
シークス	11,400	980.000	11,172,000
オーハシテクニカ	5,600	1,267.000	7,095,200
白銅	2,900	2,422.000	7,023,800
伊藤忠商事	527,800	3,878.000	2,046,808,400
丸紅	743,800	1,395.500	1,037,972,900
長瀬産業	41,300	1,826.000	75,413,800
蝶理	4,800	1,731.000	8,308,800
豊田通商	75,500	4,600.000	347,300,000
三共生興	14,300	527.000	7,536,100
兼松	26,900	1,309.000	35,212,100
三井物産	586,000	3,101.000	1,817,186,000
日本紙パルプ商事	4,000	3,820.000	15,280,000
カメイ	9,500	1,018.000	9,671,000
スターゼン	6,000	1,964.000	11,784,000
山善	30,800	939.000	28,921,200
椿本興業	1,900	3,580.000	6,802,000
住友商事	475,900	2,015.000	958,938,500
内田洋行	3,400	4,735.000	16,099,000
三菱商事	565,500	4,304.000	2,433,912,000
第一実業	3,600	3,665.000	13,194,000
キヤノンマーケティングジャパン	19,100	2,740.000	52,334,000
西華産業	5,200	1,603.000	8,335,600

佐藤商事	7,100	1,108.000	7,866,800
菱洋エレクトロ	5,200	2,001.000	10,405,200
東京産業	8,500	698.000	5,933,000
ユアサ商事	6,900	2,855.000	19,699,500
神鋼商事	2,000	3,255.000	6,510,000
阪和興業	14,800	3,065.000	45,362,000
正栄食品工業	4,900	3,960.000	19,404,000
カナデン	8,100	917.000	7,427,700
菱電商事	6,800	1,635.000	11,118,000
岩谷産業	18,200	5,060.000	92,092,000
ナイス	3,100	1,864.000	5,778,400
極東貿易	2,700	2,060.000	5,562,000
アステナホールディングス	13,500	423.000	5,710,500
三愛オブリ	18,900	930.000	17,577,000
稲畑産業	16,300	2,082.000	33,936,600
G S Iクレオス	4,700	1,186.000	5,574,200
明和産業	7,500	885.000	6,637,500
ワキタ	17,000	1,046.000	17,782,000
東邦ホールディングス	25,100	2,070.000	51,957,000
サンゲツ	20,200	1,523.000	30,764,600
ミツウロコグループホールディングス	11,800	1,006.000	11,870,800
シナネンホールディングス	3,200	3,330.000	10,656,000
伊藤忠エネクス	15,800	1,051.000	16,605,800
サンリオ	23,100	2,740.000	63,294,000
サンワ テクノス	5,400	1,309.000	7,068,600
リョーサン	8,600	2,254.000	19,384,400
新光商事	13,300	933.000	12,408,900
トーホー	5,400	1,135.000	6,129,000
三信電気	4,900	1,521.000	7,452,900
東陽テクニカ	9,100	1,015.000	9,236,500
モスフードサービス	9,900	2,942.000	29,125,800
加賀電子	6,800	2,960.000	20,128,000
ソーダニッカ	9,900	669.000	6,623,100
立花エレクトック	6,500	1,610.000	10,465,000
P A L T A C	10,700	4,605.000	49,273,500
太平洋興発	7,300	608.000	4,438,400
西本Wismettacホールディングス	2,200	2,597.000	5,713,400
国際紙パルプ商事	19,400	291.000	5,645,400
ヤマタネ	5,200	1,680.000	8,736,000
日鉄物産	5,100	5,170.000	26,367,000
泉州電業	2,200	5,040.000	11,088,000
トラスコ中山	15,500	2,039.000	31,604,500
オートバックスセブン	26,300	1,346.000	35,399,800
モリト	7,800	749.000	5,842,200
加藤産業	10,600	3,315.000	35,139,000
イノテック	5,500	1,311.000	7,210,500
イエローハット	12,900	1,580.000	20,382,000

J Kホールディングス	6,800	1,085.000	7,378,000
日伝	6,500	2,169.000	14,098,500
杉本商事	4,200	2,026.000	8,509,200
因幡電機産業	19,400	2,518.000	48,849,200
東テク	3,100	2,590.000	8,029,000
ミスミグループ本社	94,600	3,225.000	305,085,000
タキヒヨー	4,400	1,074.000	4,725,600
スズケン	29,700	3,780.000	112,266,000
ジェコス	7,500	779.000	5,842,500
ローソン	16,900	4,780.000	80,782,000
サンエー	5,500	4,065.000	22,357,500
カワチ薬品	5,900	2,045.000	12,065,500
エービーシー・マート	11,800	5,210.000	61,478,000
アスクル	17,200	1,602.000	27,554,400
ゲオホールディングス	10,300	1,257.000	12,947,100
アダストリア	8,200	2,111.000	17,310,200
くら寿司	8,000	3,350.000	26,800,000
キャンドウ	3,900	2,300.000	8,970,000
パルグループホールディングス	7,400	1,386.000	10,256,400
エディオン	33,300	1,096.000	36,496,800
サーラコーポレーション	17,100	606.000	10,362,600
ハローズ	3,700	3,020.000	11,174,000
フジオフードグループ本社	7,900	1,334.000	10,538,600
あみやき亭	2,800	2,882.000	8,069,600
大黒天物産	2,500	4,780.000	11,950,000
ハニーズホールディングス	7,700	1,052.000	8,100,400
アルペン	6,000	1,915.000	11,490,000
クオールホールディングス	10,000	1,065.000	10,650,000
ジーンズホールディングス	5,300	4,390.000	23,267,000
ビックカメラ	43,800	1,075.000	47,085,000
D C Mホールディングス	45,900	1,041.000	47,781,900
Monotaro	95,500	2,276.000	217,358,000
アークランドサービスホールディングス	6,100	2,201.000	13,426,100
J . フロント リテイリング	90,700	954.000	86,527,800
ドトール・日レスホールディングス	12,700	1,463.000	18,580,100
マツキヨココカラ&カンパニー	46,400	4,245.000	196,968,000
ブロンコビリー	5,200	2,305.000	11,986,000
Z O Z O	52,200	3,210.000	167,562,000
物語コーポレーション	3,800	5,240.000	19,912,000
三越伊勢丹ホールディングス	132,100	953.000	125,891,300
H a m e e	3,900	1,079.000	4,208,100
ウエルシアホールディングス	40,100	2,553.000	102,375,300
クリエイトS Dホールディングス	10,800	2,900.000	31,320,000
チムニー	5,100	1,145.000	5,839,500
シュッピン	7,200	1,242.000	8,942,400
オイシックス・ラ・大地	10,900	2,840.000	30,956,000
ネクステージ	15,300	1,915.000	29,299,500
ジョイフル本田	22,400	1,507.000	33,756,800

鳥貴族ホールディングス	3,700	1,790.000	6,623,000
ホットランド	7,800	1,336.000	10,420,800
すかいらーくホールディングス	97,800	1,532.000	149,829,600
S F Pホールディングス	5,500	1,391.000	7,650,500
綿半ホールディングス	7,000	1,316.000	9,212,000
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	1,073.000	22,103,800
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,300	1,009.000	5,347,700
B E E N O S	4,400	1,899.000	8,355,600
あさひ	6,400	1,316.000	8,422,400
日本調剤	5,500	1,222.000	6,721,000
コスモス薬品	7,600	11,600.000	88,160,000
セブン&アイ・ホールディングス	295,500	5,674.000	1,676,667,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	40,700	769.000	31,298,300
ツルハホールディングス	16,500	6,490.000	107,085,000
サンマルクホールディングス	8,000	1,469.000	11,752,000
トリドールホールディングス	18,800	2,372.000	44,593,600
T O K Y O B A S E	9,200	342.000	3,146,400
J Mホールディングス	5,900	1,616.000	9,534,400
アレンザホールディングス	6,600	971.000	6,408,600
串カツ田中ホールディングス	2,600	1,733.000	4,505,800
バロックジャパンリミテッド	7,700	777.000	5,982,900
クスリのアオキホールディングス	7,600	5,710.000	43,396,000
F O O D & L I F E C O M P A N I E S	44,200	3,110.000	137,462,000
メディカルシステムネットワーク	9,000	504.000	4,536,000
ノジマ	12,000	2,499.000	29,988,000
カッパ・クリエイト	11,800	1,322.000	15,599,600
良品計画	86,800	1,145.000	99,386,000
アドヴァングループ	9,900	809.000	8,009,100
アルビス	3,400	2,221.000	7,551,400
G - 7ホールディングス	8,900	1,547.000	13,768,300
イオン北海道	13,500	1,025.000	13,837,500
コジマ	14,000	608.000	8,512,000
コーナン商事	10,700	3,645.000	39,001,500
エコス	3,300	1,943.000	6,411,900
ワタミ	10,800	911.000	9,838,800
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	1,952.000	294,947,200
西松屋チェーン	16,400	1,589.000	26,059,600
ゼンショーホールディングス	36,900	2,971.000	109,629,900
幸楽苑ホールディングス	6,800	1,246.000	8,472,800
サイゼリヤ	11,500	2,344.000	26,956,000
V Tホールディングス	28,400	450.000	12,780,000
フジ・コーポレーション	5,600	1,076.000	6,025,600
ユナイテッドアローズ	8,300	1,771.000	14,699,300
ハイデイ日高	10,700	1,821.000	19,484,700

コロワイド	31,400	1,647.000	51,715,800
壱番屋	5,300	4,720.000	25,016,000
スギホールディングス	15,200	5,450.000	82,840,000
薬王堂ホールディングス	4,000	1,738.000	6,952,000
スクロール	12,300	788.000	9,692,400
ヨンドシーホールディングス	7,700	1,665.000	12,820,500
木曾路	10,700	2,034.000	21,763,800
S R Sホールディングス	14,900	803.000	11,964,700
千趣会	17,900	393.000	7,034,700
リテールパートナーズ	9,800	1,113.000	10,907,400
ケーヨー	15,800	895.000	14,141,000
上新電機	8,200	1,943.000	15,932,600
日本瓦斯	36,900	1,517.000	55,977,300
ロイヤルホールディングス	13,300	2,050.000	27,265,000
いなげや	9,700	1,345.000	13,046,500
チヨダ	12,200	695.000	8,479,000
ライフコーポレーション	7,000	2,878.000	20,146,000
リンガーハット	10,000	2,213.000	22,130,000
Mr Max HD	12,200	587.000	7,161,400
A O K Iホールディングス	16,300	598.000	9,747,400
オークワ	12,900	859.000	11,081,100
コメリ	11,400	2,580.000	29,412,000
青山商事	17,700	655.000	11,593,500
しまむら	8,800	11,210.000	98,648,000
高島屋	55,900	1,160.000	64,844,000
松屋	17,000	716.000	12,172,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	34,800	858.000	29,858,400
近鉄百貨店	3,500	2,555.000	8,942,500
丸井グループ	59,600	2,229.000	132,848,400
アクシアル リテイリング	5,900	3,360.000	19,824,000
イオン	290,700	2,483.500	721,953,450
イズミ	13,900	2,746.000	38,169,400
平和堂	13,400	1,939.000	25,982,600
フジ	20,600	2,209.000	45,505,400
ヤオコー	8,700	6,710.000	58,377,000
ゼビオホールディングス	11,400	902.000	10,282,800
ケーズホールディングス	69,400	1,260.000	87,444,000
日産東京販売ホールディングス	22,300	219.000	4,883,700
Genky Drug Stores	3,400	3,630.000	12,342,000
ブックオフグループホールディングス	5,600	999.000	5,594,400
ギフトホールディングス	1,800	2,342.000	4,215,600
アインホールディングス	10,200	5,750.000	58,650,000
元気寿司	2,900	2,457.000	7,125,300
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	1,482.000	17,784,000
ニトリホールディングス	29,900	13,535.000	404,696,500
グルメ杵屋	10,800	995.000	10,746,000
吉野家ホールディングス	26,500	2,333.000	61,824,500

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	1,093.000	15,192,700
関西フードマーケット	6,300	1,252.000	7,887,600
王将フードサービス	4,900	5,980.000	29,302,000
プレナス	8,700	1,869.000	16,260,300
ミニストップ	7,000	1,380.000	9,660,000
アークス	13,900	2,002.000	27,827,800
バローホールディングス	16,200	2,017.000	32,675,400
ベルク	3,400	5,290.000	17,986,000
ファーストリテイリング	10,100	61,240.000	618,524,000
サンドラッグ	28,600	2,957.000	84,570,200
ベルーナ	17,100	724.000	12,380,400
めぶきフィナンシャルグループ	390,200	255.000	99,501,000
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	981.000	174,912,300
富山第一銀行	9,800	314.000	3,077,200
コンコルディア・フィナンシャルグループ	429,200	468.000	200,865,600
西日本フィナンシャルホールディングス	49,600	776.000	38,489,600
三十三フィナンシャルグループ	7,700	1,418.000	10,918,600
第四北越フィナンシャルグループ	12,400	2,488.000	30,851,200
ひろぎんホールディングス	111,700	635.000	70,929,500
おきなわフィナンシャルグループ	7,000	2,140.000	14,980,000
十六フィナンシャルグループ	10,500	2,124.000	22,302,000
北國フィナンシャルホールディングス	7,400	3,315.000	24,531,000
プロクレアホールディングス	7,600	1,754.000	13,330,400
新生銀行	49,400	2,262.000	111,742,800
あおぞら銀行	41,500	2,569.000	106,613,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,741,100	744.200	3,528,326,620
りそなホールディングス	857,600	560.200	480,427,520
三井住友トラスト・ホールディングス	142,800	3,987.000	569,343,600
三井住友フィナンシャルグループ	523,400	3,896.000	2,039,166,400
千葉銀行	251,700	749.000	188,523,300
群馬銀行	140,200	362.000	50,752,400
武蔵野銀行	11,600	1,748.000	20,276,800
筑波銀行	26,300	193.000	5,075,900
七十七銀行	23,700	1,559.000	36,948,300
秋田銀行	4,300	1,664.000	7,155,200
山形銀行	10,600	838.000	8,882,800
岩手銀行	6,000	1,851.000	11,106,000
東邦銀行	73,100	201.000	14,693,100
東北銀行	2,000	990.000	1,980,000
ふくおかフィナンシャルグループ	63,300	2,373.000	150,210,900
静岡銀行	183,800	839.000	154,208,200
スルガ銀行	67,500	406.000	27,405,000
八十二銀行	168,500	418.000	70,433,000
山梨中央銀行	10,800	970.000	10,476,000



大垣共立銀行	15,100	1,889.000	28,523,900
福井銀行	8,000	1,347.000	10,776,000
清水銀行	4,400	1,557.000	6,850,800
富山銀行	2,400	2,043.000	4,903,200
滋賀銀行	14,300	2,350.000	33,605,000
南都銀行	12,200	1,997.000	24,363,400
百五銀行	73,900	338.000	24,978,200
京都銀行	27,000	5,330.000	143,910,000
紀陽銀行	25,800	1,394.000	35,965,200
ほくほくフィナンシャルグループ	47,600	850.000	40,460,000
山陰合同銀行	45,900	642.000	29,467,800
中国銀行	59,800	926.000	55,374,800
伊予銀行	99,300	619.000	61,466,700
百十四銀行	9,200	1,656.000	15,235,200
四国銀行	13,400	757.000	10,143,800
阿波銀行	11,800	2,122.000	25,039,600
大分銀行	5,500	1,816.000	9,988,000
宮崎銀行	5,400	2,034.000	10,983,600
佐賀銀行	4,500	1,409.000	6,340,500
琉球銀行	18,200	790.000	14,378,000
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	1,565.500	1,514,464,700
山口フィナンシャルグループ	88,700	708.000	62,799,600
名古屋銀行	5,800	2,916.000	16,912,800
北洋銀行	115,700	241.000	27,883,700
愛知銀行	2,900	4,565.000	13,238,500
中京銀行	4,000	1,672.000	6,688,000
愛媛銀行	13,100	891.000	11,672,100
京葉銀行	33,500	490.000	16,415,000
栃木銀行	43,200	236.000	10,195,200
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	1,275.000	10,837,500
池田泉州ホールディングス	94,200	174.000	16,390,800
F P G	27,600	732.000	20,203,200
ジャパンインベストメントアドバイザー	6,900	1,161.000	8,010,900
S B Iホールディングス	92,700	2,865.000	265,585,500
ジャフコ グループ	29,300	1,587.000	46,499,100
大和証券グループ本社	566,100	637.700	361,001,970
野村ホールディングス	1,153,500	504.400	581,825,400
岡三証券グループ	62,200	356.000	22,143,200
丸三証券	22,100	473.000	10,453,300
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	85,100	399.000	33,954,900
水戸証券	26,100	261.000	6,812,100
いちよし証券	17,300	583.000	10,085,900
松井証券	37,500	828.000	31,050,000
マネックスグループ	62,000	606.000	37,572,000

極東証券	10,300	698.000	7,189,400
岩井コスモホールディングス	8,300	1,249.000	10,366,700
アイザワ証券グループ	14,200	675.000	9,585,000
スパークス・グループ	41,100	261.000	10,727,100
かんぼ生命保険	76,300	2,096.000	159,924,800
S O M P Oホールディングス	123,900	5,129.000	635,483,100
アニコム ホールディングス	26,500	604.000	16,006,000
M S & A Dインシュアランスグループ ホールディングス	169,100	3,781.000	639,367,100
第一生命ホールディングス	371,800	2,527.000	939,538,600
東京海上ホールディングス	249,000	6,787.000	1,689,963,000
T & Dホールディングス	195,800	1,639.000	320,916,200
アドバンスクリエイト	5,500	907.000	4,988,500
全国保証	18,200	4,475.000	81,445,000
ジェイリース	2,900	1,566.000	4,541,400
日本モーゲージサービス	4,100	953.000	3,907,300
アルヒ	12,400	1,009.000	12,511,600
プレミアグループ	4,200	3,785.000	15,897,000
ネットプロテクションズホールディング ス	18,200	675.000	12,285,000
クレディセゾン	48,200	1,488.000	71,721,600
芙蓉総合リース	7,800	7,020.000	54,756,000
みずほリース	11,700	2,994.000	35,029,800
東京センチュリー	14,500	4,000.000	58,000,000
日本証券金融	31,600	926.000	29,261,600
アイフル	129,000	371.000	47,859,000
リコーリース	7,100	3,350.000	23,785,000
イオンフィナンシャルサービス	40,500	1,184.000	47,952,000
アコム	151,100	335.000	50,618,500
ジャックス	8,600	3,260.000	28,036,000
オリエントコーポレーション	208,600	123.000	25,657,800
オリックス	449,500	2,338.500	1,051,155,750
三菱H Cキャピタル	277,000	578.000	160,106,000
日本取引所グループ	188,700	2,014.000	380,041,800
イー・ギャランティ	11,300	2,129.000	24,057,700
N E Cキャピタルソリューション	4,000	2,060.000	8,240,000
いちご	89,600	287.000	25,715,200
日本駐車場開発	101,600	154.000	15,646,400
スター・マイカ・ホールディングス	6,800	1,556.000	10,580,800
S R Eホールディングス	2,600	2,891.000	7,516,600
ヒューリック	180,900	1,087.000	196,638,300
三栄建築設計	4,300	1,661.000	7,142,300
野村不動産ホールディングス	39,000	2,968.000	115,752,000
三重交通グループホールディングス	20,700	456.000	9,439,200
サムティ	10,100	2,101.000	21,220,100
ディア・ライフ	13,800	506.000	6,982,800
地主	6,500	1,871.000	12,161,500
プレサンスコーポレーション	11,200	1,542.000	17,270,400

日本管理センター	6,700	979.000	6,559,300
フージャースホールディングス	13,300	634.000	8,432,200
オープンハウスグループ	24,000	4,995.000	119,880,000
東急不動産ホールディングス	223,200	667.000	148,874,400
飯田グループホールディングス	63,000	2,110.000	132,930,000
A n d D oホールディングス	5,700	897.000	5,112,900
シーアールイー	4,100	1,621.000	6,646,100
ケイアイスター不動産	3,900	5,380.000	20,982,000
グッドコムアセット	5,500	1,073.000	5,901,500
ジェイ・エス・ビー	2,100	3,365.000	7,066,500
パーク24	41,000	1,829.000	74,989,000
パラカ	4,400	1,711.000	7,528,400
宮越ホールディングス	4,500	839.000	3,775,500
三井不動産	344,400	2,677.000	921,958,800
三菱地所	497,700	1,857.500	924,477,750
平和不動産	13,500	4,000.000	54,000,000
東京建物	74,800	1,791.000	133,966,800
京阪神ビルディング	13,200	1,316.000	17,371,200
住友不動産	159,000	3,385.000	538,215,000
テーオーシー	16,900	668.000	11,289,200
東京楽天地	1,600	3,930.000	6,288,000
スターツコーポレーション	11,200	2,324.000	26,028,800
フジ住宅	12,900	613.000	7,907,700
空港施設	13,200	532.000	7,022,400
ゴールドクレスト	7,700	1,653.000	12,728,100
日神グループホールディングス	17,300	455.000	7,871,500
日本エスコン	16,100	800.000	12,880,000
タカラレーベン	41,800	296.000	12,372,800
A V A N T I A	7,900	830.000	6,557,000
イオンモール	38,400	1,559.000	59,865,600
カチタス	19,500	3,170.000	61,815,000
トーセイ	12,200	1,073.000	13,090,600
サンフロンティア不動産	12,800	1,046.000	13,388,800
F Jネクストホールディングス	9,500	988.000	9,386,000
日本空港ビルデング	29,000	5,420.000	157,180,000
日本工営	4,900	2,824.000	13,837,600
L I F U L L	30,100	227.000	6,832,700
ミクシィ	17,000	2,256.000	38,352,000
ジェイエイシーリクルートメント	6,600	1,800.000	11,880,000
日本M & Aセンターホールディングス	120,700	1,649.000	199,034,300
メンバーズ	2,600	3,220.000	8,372,000
UTグループ	10,600	2,928.000	31,036,800
アイティメディア	4,300	1,688.000	7,258,400
E・Jホールディングス	5,200	1,137.000	5,912,400
夢真ビーネックスグループ	23,900	1,512.000	36,136,800
コシダカホールディングス	20,500	778.000	15,949,000
パソナグループ	7,900	2,061.000	16,281,900
リンクアンドモチベーション	18,800	466.000	8,760,800

エス・エム・エス	25,200	3,160.000	79,632,000
パーソルホールディングス	73,200	2,570.000	188,124,000
リニカル	7,000	793.000	5,551,000
クックパッド	30,300	279.000	8,453,700
スタジオアリス	4,200	2,274.000	9,550,800
シミックホールディングス	5,400	1,487.000	8,029,800
総合警備保障	29,300	3,570.000	104,601,000
カカクコム	54,100	2,731.000	147,747,100
アイロムグループ	3,500	1,984.000	6,944,000
ルネサンス	6,700	925.000	6,197,500
ディップ	12,900	4,100.000	52,890,000
デジタルホールディングス	5,700	1,438.000	8,196,600
新日本科学	9,700	1,427.000	13,841,900
ベネフィット・ワン	26,900	2,070.000	55,683,000
エムスリー	129,300	4,394.000	568,144,200
アウトソーシング	42,300	1,267.000	53,594,100
ウェルネット	15,500	488.000	7,564,000
ワールドホールディングス	3,300	2,378.000	7,847,400
ディー・エヌ・エー	28,500	1,870.000	53,295,000
博報堂D Yホールディングス	102,000	1,525.000	155,550,000
ぐるなび	16,300	436.000	7,106,800
タカミヤ	15,600	344.000	5,366,400
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	429.000	10,381,800
ライク	3,200	2,144.000	6,860,800
エスプール	21,000	1,377.000	28,917,000
WDBホールディングス	3,700	2,720.000	10,064,000
アドウェイズ	12,000	805.000	9,660,000
バリューコマース	5,700	3,605.000	20,548,500
インフォマート	81,600	659.000	53,774,400
J Pホールディングス	27,600	210.000	5,796,000
プレステージ・インターナショナル	28,400	624.000	17,721,600
アミューズ	4,800	1,924.000	9,235,200
ドリームインキュベータ	2,700	1,908.000	5,151,600
クイック	6,100	1,509.000	9,204,900
電通グループ	75,500	4,750.000	358,625,000
ぴあ	2,900	3,155.000	9,149,500
イオンファンタジー	3,800	2,206.000	8,382,800
シーティーエス	10,000	844.000	8,440,000
H . U . グループホールディングス	19,500	2,896.000	56,472,000
アルプス技研	7,300	1,943.000	14,183,900
日本空調サービス	10,600	794.000	8,416,400
オリエンタルランド	86,600	22,490.000	1,947,634,000
ダスキン	17,600	2,734.000	48,118,400
明光ネットワークジャパン	13,700	569.000	7,795,300
ファルコホールディングス	4,500	2,100.000	9,450,000
ラウンドワン	20,700	1,445.000	29,911,500
リゾートトラスト	34,000	2,167.000	73,678,000

ビー・エム・エル	9,400	3,275.000	30,785,000
りらいあコミュニケーションズ	11,900	1,041.000	12,387,900
リソー教育	36,500	370.000	13,505,000
ユー・エス・エス	82,300	2,119.000	174,393,700
東京個別指導学院	9,200	571.000	5,253,200
サイバーエージェント	180,900	1,370.000	247,833,000
楽天グループ	377,100	944.000	355,982,400
クリーク・アンド・リバー社	4,500	2,125.000	9,562,500
モーニングスター	16,200	545.000	8,829,000
山田コンサルティンググループ	5,000	1,183.000	5,915,000
セントラルスポーツ	3,900	2,361.000	9,207,900
フルキャストホールディングス	6,400	2,412.000	15,436,800
エン・ジャパン	11,800	3,165.000	37,347,000
テクノプロ・ホールディングス	44,000	3,230.000	142,120,000
アイ・アールジャパンホールディングス	3,600	4,305.000	15,498,000
Ke e P e r 技研	5,100	2,634.000	13,433,400
Gunosy	5,200	1,135.000	5,902,000
イー・ガーディアン	3,400	2,969.000	10,094,600
ジャパンマテリアル	22,500	1,888.000	42,480,000
ベクトル	11,200	1,286.000	14,403,200
チャーム・ケア・コーポレーション	6,100	1,225.000	7,472,500
キャリアリンク	3,300	1,403.000	4,629,900
I B J	8,000	722.000	5,776,000
アサンテ	5,200	1,442.000	7,498,400
バリューHR	7,000	1,366.000	9,562,000
M&Aキャピタルパートナーズ	6,100	3,990.000	24,339,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,900	1,134.000	4,422,600
E R Iホールディングス	2,900	1,340.000	3,886,000
シグマクシス・ホールディングス	9,600	1,060.000	10,176,000
ウィルグループ	6,100	1,103.000	6,728,300
メドピア	5,800	3,200.000	18,560,000
リクルートホールディングス	565,300	4,877.000	2,756,968,100
エラン	12,100	1,009.000	12,208,900
日本郵政	955,900	891.500	852,184,850
ベルシステム24ホールディングス	10,800	1,499.000	16,189,200
鎌倉新書	11,000	621.000	6,831,000
エアトリ	5,000	3,280.000	16,400,000
アトラエ	5,600	1,812.000	10,147,200
ストライク	3,300	4,060.000	13,398,000
ソラスト	18,400	854.000	15,713,600
インソース	7,400	2,337.000	17,293,800
ベイカレント・コンサルティング	5,200	40,500.000	210,600,000
Orchestra Holdings	1,800	2,621.000	4,717,800
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	23,300	1,581.000	36,837,300
ウェルビー	6,000	978.000	5,868,000
エル・ティー・エス	1,500	2,898.000	4,347,000

ミダックホールディングス	3,600	2,168.000	7,804,800	
日総工産	7,300	667.000	4,869,100	
キュービーネットホールディングス	4,500	1,378.000	6,201,000	
R P Aホールディングス	14,400	352.000	5,068,800	
スプリックス	3,000	1,202.000	3,606,000	
マネジメントソリューションズ	3,800	4,665.000	17,727,000	
カーブスホールディングス	21,000	755.000	15,855,000	
F A S T F I T N E S S J A P A N	1,500	1,833.000	2,749,500	
ダイレクトマーケティングミックス	9,400	1,572.000	14,776,800	
ポピンズ	2,200	2,025.000	4,455,000	
L I T A L I C O	6,200	2,703.000	16,758,600	
アドバンテッジリスクマネジメント	6,000	513.000	3,078,000	
リログループ	40,600	1,872.000	76,003,200	
東祥	6,400	1,698.000	10,867,200	
T R Eホールディングス	10,300	2,010.000	20,703,000	
人・夢・技術グループ	3,600	2,083.000	7,498,800	
エイチ・アイ・エス	16,500	2,251.000	37,141,500	
ラックランド	3,600	2,939.000	10,580,400	
共立メンテナンス	13,000	4,630.000	60,190,000	
イチネンホールディングス	8,500	1,232.000	10,472,000	
建設技術研究所	4,900	2,311.000	11,323,900	
燦ホールディングス	4,400	1,516.000	6,670,400	
東京テアトル	6,100	1,224.000	7,466,400	
ナガワ	2,300	9,110.000	20,953,000	
東京都競馬	5,600	4,415.000	24,724,000	
カナモト	12,700	1,932.000	24,536,400	
西尾レントオール	6,700	2,725.000	18,257,500	
トランス・コスモス	9,400	3,090.000	29,046,000	
乃村工藝社	31,600	874.000	27,618,400	
日本管財	7,600	2,756.000	20,945,600	
トーカイ	6,900	1,681.000	11,598,900	
セコム	72,200	8,928.000	644,601,600	
セントラル警備保障	4,000	2,054.000	8,216,000	
丹青社	16,300	783.000	12,762,900	
メイテック	9,100	6,890.000	62,699,000	
応用地質	8,300	1,947.000	16,160,100	
船井総研ホールディングス	15,200	2,144.000	32,588,800	
オオバ	8,100	784.000	6,350,400	
ベネッセホールディングス	25,100	2,212.000	55,521,200	
イオンディライト	9,000	2,696.000	24,264,000	
ダイセキ	13,300	4,500.000	59,850,000	
合 計	82,877,500		196,699,150,170	

## (b)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

## 外国株式インデックス・マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2021年4月26日現在)	(2022年4月26日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	1,942,451,000	3,823,150,343
金銭信託	302,937,580	3,335,998
コール・ローン	695,167,542	168,265,306
株式	283,850,458,884	367,861,655,320
投資証券	6,801,473,940	10,140,612,029
派生商品評価勘定	59,535,179	23,850,169
未収入金	45,617,843	9,336,624
未収配当金	309,276,064	411,028,428
差入委託証拠金	1,650,022,983	1,745,293,514
流動資産合計	295,656,941,015	384,186,527,731
資産合計	295,656,941,015	384,186,527,731
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	372,922	134,319,687
前受金	59,485,972	-
未払解約金	1,041,495,833	600,406,328
未払利息	2,012	-
その他未払費用	20,043	1,452
流動負債合計	1,101,376,782	734,727,467
負債合計	1,101,376,782	734,727,467
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	57,943,987,779	63,556,720,108
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	236,611,576,454	319,895,080,156
元本等合計	294,555,564,233	383,451,800,264
純資産合計	294,555,564,233	383,451,800,264
負債純資産合計	295,656,941,015	384,186,527,731

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年4月27日 至 2022年4月26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。

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	（2021年4月26日現在）	（2022年4月26日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	57,943,987,779口	63,556,720,108口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 5.0835円 （1万口当たりの純資産額50,835円）	1口当たり純資産額 6.0332円 （1万口当たりの純資産額60,332円）

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年4月27日 至 2022年4月26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。



<p>2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク</p>	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っております。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年4月26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26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	SPMINI 2106	2,876,715,575	-	2,925,410,377	48,694,802
	SPI200 2106	145,020,124	-	146,917,795	1,897,671
	FTSE 2106	174,694,085	-	175,703,670	1,009,585
	DJ EUR 2106	618,765,224	-	626,649,138	7,883,914
	小計	3,815,195,008	-	3,874,680,980	59,485,972
	合計	3,815,195,008	-	3,874,680,980	59,485,972

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
為替予約取引 売建	アメリカ・ドル	169,433,700	-	169,385,320	48,380
	イギリス・ポンド	8,965,740	-	8,987,382	21,642
	イスラエル・シェケル	330,160	-	331,894	1,734

市場取引 以外の取 引	オーストラリア・ ドル	4,159,600	-	4,184,500	24,900
	カナダ・ドル	15,563,400	-	15,580,614	17,214
	シンガポール・ド ル	811,440	-	813,690	2,250
	スイス・フラン	11,771,100	-	11,813,200	42,100
	スウェーデン・ク ローナ	2,690,100	-	2,702,700	12,600
	デンマーク・ク ローネ	1,046,580	-	1,053,600	7,020
	ニュージーラン ド・ドル	772,557	-	776,893	4,336
	ノルウェー・ク ローネ	387,150	-	390,600	3,450
	ユーロ	50,680,070	-	50,915,339	235,269
	香港・ドル	834,420	-	834,000	420
	小計	267,446,017	-	267,769,732	323,715
	合 計	267,446,017	-	267,769,732	323,715

(2022年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	S&P 500 EMINI FUT JUN22	4,122,572,256	-	4,025,998,515	96,573,741
	SPI 200 FUTURES JUN22	205,615,274	-	201,609,513	4,005,761
	FTSE 100 IDX FUT JUN22	241,938,385	-	239,617,512	2,320,873
	EURO STOXX 50 JUN22	756,038,201	-	741,472,116	14,566,085
	小計	5,326,164,116	-	5,208,697,656	117,466,460
	合 計	5,326,164,116	-	5,208,697,656	117,466,460

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1)原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち 1年超		
市場取引 以外の取 引	為替予約取引 買建				
	スウェーデン・ク ローナ	135,101	-	131,500	3,601
	小計	135,101	-	131,500	3,601
	売建				
	アメリカ・ドル	448,816,113	-	446,564,421	2,251,692
	カナダ・ドル	25,292,154	-	25,049,920	242,234
	オーストラリア・ ドル	13,173,611	-	12,847,550	326,061
	香港・ドル	6,537,970	-	6,503,796	34,174
	シンガポール・ド ル	3,743,098	-	3,718,220	24,878
	ニュージーラン ド・ドル	863,930	-	845,570	18,360
	イギリス・ポンド	42,843,978	-	42,284,300	559,678
	イスラエル・シュ ケル	1,570,470	-	1,554,316	16,154
	スイス・フラン	45,708,002	-	45,326,920	381,082
	デンマーク・ク ローネ	5,753,758	-	5,704,369	49,389
	ノルウェー・ク ローネ	3,111,615	-	3,081,875	29,740
	スウェーデン・ク ローナ	6,680,540	-	6,575,000	105,540
	ユーロ	168,588,696	-	165,627,135	2,961,561
	小計	772,683,935	-	765,683,392	7,000,543
	合 計	772,819,036	-	765,814,892	6,996,942

## (注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

自 2021年4月27日 至 2022年4月26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26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	58,066,751,593円
同期中における追加設定元本額	16,895,224,068円
同期中における一部解約元本額	17,017,987,882円
2021年4月26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	28,763,062,087円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	278,659,320円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,185,860,476円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	826,468,614円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	68,282,666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)	6,153,493円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	17,918,101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)	44,256,436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)	43,724,486円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	93,759,250円
外国株式指数ファンド	597,608,127円
三井住友・DCつみたてN I S A・全海外株インデックスファンド	9,332,591,971円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	226,710,914円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	247,923,480円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	161,310,710円
イオン・バランス戦略ファンド	53,042,866円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	13,361,494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)	79,384,983円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	253,475,380円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	124,628,072円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	143,424,749円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	31,364,778円
三井住友D S・外国株式インデックス年金ファンド	185,695,612円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	3,502,496円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	13,766,131円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	11,897,831円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	1,957,599円
S M B C・DCインデックスファンド(M S C Iコクサイ)	36,164,679円
S M A M・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	765,606,897円

バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	5,449,180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 >	890,427,813円
SMAM・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	1,017,321,892円
SMAM・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	4,322,684,584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 >	582,908,081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 >	46,776,376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 >	563,978,699円
SMAM・バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 >	436,244,612円
SMAM・バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 >	1,003,186,093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)	249,141,886円
SMAM・グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	90,384,153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 >	9,138,921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 >	27,135,381円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 >	73,803,151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 >	168,068,608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 >	80,082,212円
SMAM・世界バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 >	2,365,412,561円
SMAM・世界バランスファンドVA2 < 適格機関投資家限定 >	154,088,266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 >	1,460,825,276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 < 適格機関投資家限定 >	341,028,483円
合計	57,943,987,779円

## (2022年4月26日現在)

## 開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	57,943,987,779円
同期中における追加設定元本額	15,824,942,750円
同期中における一部解約元本額	10,212,210,421円

## 2022年4月26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	32,824,989,661円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	257,317,370円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,047,578,763円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	747,973,617円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	60,989,172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)	5,363,638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)	16,244,720円

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	43,713,957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)	47,361,014円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	93,028,840円
外国株式指数ファンド	854,964,510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	14,459,619,207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D S・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)	120,600,881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)	193,274,372円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	223,259,235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D S・外国株式インデックス年金ファンド	772,040,864円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	4,693,304円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	20,205,997円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	19,677,700円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	1,976,165円
S M B C・DCインデックスファンド(M S C Iコクサイ)	178,127,088円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	162,944,584円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	556,407,030円
三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド	20,929,896円
S M A M・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	502,987,590円
バランスファンドV A(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	4,946,844円
S M A M・バランスファンドV A安定成長型 < 適格機関投資家限定 >	25,733,245円
S M A M・バランスファンドV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	622,840,510円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >	760,966,204円
S M A M・バランスファンドV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	3,294,948,550円
S M A M・バランスファンドV L 3 0 < 適格機関投資家限定 >	10,889,499円
S M A M・バランスファンドV L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	56,580,424円
S M A M・バランスファンドV A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	444,174,100円
S M A M・バランスファンドV L国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	37,545,497円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	93,355,655円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	445,662,014円
S M A M・バランスファンドV A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	324,389,117円
S M A M・バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	750,605,330円
S M A M・バランスV A株4 0 T < 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・V A S(適格機関投資家専用)	208,063,748円
S M A M・グローバルバランス4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	67,237,428円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	8,668,847円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	7,431,222円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	3,930,927円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	20,254,181円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	55,967,394円
S M A M・グローバルバランスファンド(標準型) V A < 適格機関投資家限定 >	114,373,759円
S M A M・グローバルバランスファンド(債券重視型) V A < 適格機関投資家限定 >	52,566,720円

S M A M ・ 世界バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	494,019,000円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	93,680,381円
S M A M ・ 外国株式インデックスファンドS A < 適格機関投資家限定 >	1,402,985,029円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	22,195,395円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016-04 < 適格機関投資家限定 >	14,310,453円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	18,636,428円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	62,157,282円
合 計	63,556,720,108円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	BAKER HUGHES CO	48,147	30.740	1,480,038.78	
	CHENIERE ENERGY INC	13,763	131.130	1,804,742.19	
	CHEVRON CORP	109,842	157.490	17,299,016.58	
	CONOCOPHILLIPS	75,728	91.660	6,941,228.48	
	COTERRA ENERGY INC	40,261	28.660	1,153,880.26	
	DEVON ENERGY CORP	36,196	56.180	2,033,491.28	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	9,236	125.820	1,162,073.52	
	EOG RESOURCES INC	33,177	111.770	3,708,193.29	
	EXXON MOBIL CORP	240,058	82.260	19,747,171.08	
	HALLIBURTON CO	48,780	35.330	1,723,397.40	
	HESS CORP	15,806	102.620	1,622,011.72	
	KINDER MORGAN INC	115,515	18.610	2,149,734.15	
	MARATHON PETROLEUM CORP	33,933	84.260	2,859,194.58	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	54,615	54.920	2,999,455.80	
	ONEOK INC	24,725	66.300	1,639,267.50	
	PHILLIPS 66	28,293	81.020	2,292,298.86	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	13,151	231.140	3,039,722.14	
	SCHLUMBERGER LTD	77,056	38.690	2,981,296.64	
	VALERO ENERGY CORP	23,182	100.880	2,338,600.16	
	WILLIAMS COS INC	71,708	33.900	2,430,901.20	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	12,372	242.760	3,003,426.72		
ALBEMARLE CORP	6,560	198.460	1,301,897.60		
AMCOR PLC	82,302	11.650	958,818.30		
AVERY DENNISON CORP	4,232	168.690	713,896.08		
BALL CORP	19,410	85.960	1,668,483.60		
CELANESE CORP	6,643	141.910	942,708.13		



CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,002	94.450	1,133,588.90	
CORTEVA INC	41,332	57.300	2,368,323.60	
CROWN HOLDINGS INC	6,863	116.610	800,294.43	
DOW INC	41,516	68.070	2,825,994.12	
DUPONT DE NEMOURS INC	27,944	67.800	1,894,603.20	
EASTMAN CHEMICAL CO	7,027	105.860	743,878.22	
ECOLAB INC	14,157	175.610	2,486,110.77	
FMC CORP	6,676	131.650	878,895.40	
FREEMONT-MCMORAN INC	85,156	41.650	3,546,747.40	
INTERNATIONAL PAPER CO	19,140	47.490	908,958.60	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	13,922	123.070	1,713,380.54	
LINDE PLC	29,358	313.990	9,218,118.42	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	16,010	105.210	1,684,412.10	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,559	360.800	1,284,087.20	
MOSAIC CO/THE	22,416	63.610	1,425,881.76	
NEWMONT CORP	46,400	72.610	3,369,104.00	
NUCOR CORP	16,292	158.560	2,583,259.52	
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,988	162.290	971,792.52	
PPG INDUSTRIES INC	13,502	129.340	1,746,348.68	
RPM INTERNATIONAL INC	7,696	84.580	650,927.68	
SEALED AIR CORP	7,895	65.370	516,096.15	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	14,500	248.020	3,596,290.00	
STEEL DYNAMICS INC	10,191	89.330	910,362.03	
VULCAN MATERIALS CO	7,555	176.010	1,329,755.55	
WESTROCK CO	13,034	49.740	648,311.16	
3M CO	32,676	148.600	4,855,653.60	
AERCAP HOLDINGS NV	8,330	50.150	417,749.50	
ALLEGION PLC	4,764	114.720	546,526.08	
AMETEK INC	13,117	127.650	1,674,385.05	
BOEING CO/THE	32,149	175.910	5,655,330.59	
CARRIER GLOBAL CORP	46,600	41.960	1,955,336.00	
CATERPILLAR INC	31,095	216.700	6,738,286.50	
CUMMINS INC	8,207	196.150	1,609,803.05	
DEERE & CO	16,702	385.510	6,438,788.02	
DOVER CORP	8,225	142.240	1,169,924.00	
EATON CORP PLC	23,221	147.070	3,415,112.47	
EMERSON ELECTRIC CO	34,129	92.210	3,147,035.09	
FASTENAL CO	32,763	56.950	1,865,852.85	
FORTIVE CORP	18,373	57.850	1,062,878.05	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	7,166	73.150	524,192.90	
GENERAC HOLDINGS INC	3,300	245.340	809,622.00	
GENERAL DYNAMICS CORP	13,847	239.180	3,311,925.46	

GENERAL ELECTRIC CO	63,295	89.880	5,688,954.60	
HEICO CORP	1,888	145.840	275,345.92	
HEICO CORP-CLASS A	4,570	119.360	545,475.20	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	39,519	191.820	7,580,534.58	
HOWMET AEROSPACE INC	19,024	34.820	662,415.68	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,107	218.530	460,442.71	
IDEX CORP	3,839	191.710	735,974.69	
ILLINOIS TOOL WORKS	18,247	204.120	3,724,577.64	
INGERSOLL-RAND INC	21,013	45.670	959,663.71	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	11,500	54.870	631,005.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	38,803	62.710	2,433,336.13	
KORNIT DIGITAL LTD	3,043	70.110	213,344.73	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	11,079	242.920	2,691,310.68	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,104	238.940	502,729.76	
LOCKHEED MARTIN CORP	14,287	442.890	6,327,569.43	
MASCO CORP	14,885	52.220	777,294.70	
NORDSON CORP	2,884	220.820	636,844.88	
NORTHROP GRUMMAN CORP	8,540	444.020	3,791,930.80	
OTIS WORLDWIDE CORP	22,881	74.600	1,706,922.60	
OWENS CORNING	5,205	88.000	458,040.00	
PACCAR INC	20,753	86.350	1,792,021.55	
PARKER HANNIFIN CORP	7,329	278.260	2,039,367.54	
PENTAIR PLC	8,220	52.770	433,769.40	
PLUG POWER INC	28,584	22.750	650,286.00	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	85,821	99.610	8,548,629.81	
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,219	261.310	1,625,086.89	
ROPER TECHNOLOGIES INC	6,180	455.270	2,813,568.60	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,600	48.730	370,348.00	
SMITH (A.O.) CORP	7,157	64.630	462,556.91	
SNAP-ON INC	3,106	223.260	693,445.56	
STANLEY BLACK & DECKER INC	9,129	141.480	1,291,570.92	
SUNRUN INC	10,669	20.550	219,247.95	
TEXTRON INC	11,803	68.330	806,498.99	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	12,759	149.440	1,906,704.96	
TRANSDIGM GROUP INC	3,010	626.640	1,886,186.40	
UNITED RENTALS INC	4,113	313.280	1,288,520.64	
WABTEC CORP	9,231	89.250	823,866.75	
WW GRAINGER INC	2,390	492.190	1,176,334.10	

XYLEM INC	10,225	84.050	859,411.25	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	8,029	87.370	701,493.73	
CINTAS CORP	5,169	409.960	2,119,083.24	
CLARIVATE PLC	19,939	16.430	327,597.77	
COPART INC	12,238	118.210	1,446,653.98	
COSTAR GROUP INC	23,804	62.650	1,491,320.60	
EQUIFAX INC	6,841	213.400	1,459,869.40	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6,927	140.350	972,204.45	
LEIDOS HOLDINGS INC	6,947	107.170	744,509.99	
REPUBLIC SERVICES INC	12,824	132.450	1,698,538.80	
ROBERT HALF INTL INC	5,555	112.180	623,159.90	
ROLLINS INC	11,493	33.400	383,866.20	
TRANSUNION	11,233	92.780	1,042,197.74	
VERISK ANALYTICS INC	8,757	213.850	1,872,684.45	
WASTE CONNECTIONS INC	15,445	136.250	2,104,381.25	
WASTE MANAGEMENT INC	23,720	155.960	3,699,371.20	
AMERCO	650	550.350	357,727.50	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6,925	103.170	714,452.25	
CSX CORP	128,276	34.640	4,443,480.64	
DELTA AIR LINES INC	8,299	43.270	359,097.73	
EXPEDITORS INTL WASH INC	8,689	100.700	874,982.30	
FEDEX CORP	14,310	205.400	2,939,274.00	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	65,402	2.860	187,049.72	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	4,411	174.050	767,734.55	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,940	49.790	395,332.60	
LYFT INC-A	13,145	33.910	445,746.95	
NORFOLK SOUTHERN CORP	13,579	259.740	3,527,009.46	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,539	279.820	1,549,922.98	
SOUTHWEST AIRLINES CO	7,076	46.430	328,538.68	
UBER TECHNOLOGIES INC	85,141	32.440	2,761,974.04	
UNION PACIFIC CORP	36,797	236.420	8,699,546.74	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	41,784	189.640	7,923,917.76	
APTIV PLC	15,307	107.630	1,647,492.41	
BORGWARNER INC	12,075	37.720	455,469.00	
FORD MOTOR CO	218,306	15.190	3,316,068.14	
GENERAL MOTORS CO	72,747	39.820	2,896,785.54	
LEAR CORP	3,736	129.480	483,737.28	
LUCID GROUP INC	21,730	19.330	420,040.90	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	9,269	33.900	314,219.10	

TESLA INC	48,490	998.020	48,393,989.80	
DR HORTON INC	18,162	74.190	1,347,438.78	
GARMIN LTD	8,444	112.810	952,567.64	
HASBRO INC	7,491	89.540	670,744.14	
LENNAR CORP-A	14,494	79.600	1,153,722.40	
LULULEMON ATHLETICA INC	6,481	368.090	2,385,591.29	
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	128.140	366,864.82	
NEWELL BRANDS INC	17,587	23.270	409,249.49	
NIKE INC -CL B	73,154	127.940	9,359,322.76	
NVR INC	173	4,353.280	753,117.44	
PELTON INTERACTIVE INC-A	15,071	20.410	307,599.11	
PULTEGROUP INC	13,075	43.670	570,985.25	
VF CORP	20,583	54.310	1,117,862.73	
WHIRLPOOL CORP	3,212	178.870	574,530.44	
AIRBNB INC-CLASS A	17,263	158.390	2,734,286.57	
ARAMARK	13,242	37.990	503,063.58	
BOOKING HOLDINGS INC	2,368	2,246.040	5,318,622.72	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	13,336	68.500	913,516.00	
CARNIVAL CORP	48,156	18.880	909,185.28	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,586	1,516.000	2,404,376.00	
DARDEN RESTAURANTS INC	7,606	138.130	1,050,616.78	
DOMINO'S PIZZA INC	2,121	378.160	802,077.36	
DRAFTKINGS INC - CL A	16,742	14.680	245,772.56	
EXPEDIA GROUP INC	8,061	186.770	1,505,552.97	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	15,836	155.940	2,469,465.84	
LAS VEGAS SANDS CORP	17,634	36.290	639,937.86	
MARRIOTT INTERNATIONAL - CL A	15,697	182.480	2,864,388.56	
MCDONALD'S CORP	42,751	252.880	10,810,872.88	
MELCO RESORTS & ENTERT- ADR	9,746	6.190	60,327.74	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,198	42.030	932,981.94	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	11,890	82.380	979,498.20	
STARBUCKS CORP	67,557	77.980	5,268,094.86	
VAIL RESORTS INC	2,038	263.520	537,053.76	
WYNN RESORTS LTD	4,913	72.210	354,767.73	
YUM! BRANDS INC	17,414	121.270	2,111,795.78	
ADVANCE AUTO PARTS INC	3,426	223.870	766,978.62	
AMAZON.COM INC	25,910	2,921.480	75,695,546.80	
AUTOZONE INC	1,235	2,195.680	2,711,664.80	
BATH & BODY WORKS INC	15,400	54.100	833,140.00	

BEST BUY CO INC	12,132	93.070	1,129,125.24	
BURLINGTON STORES INC	3,391	209.250	709,566.75	
CARMAX INC	8,427	90.450	762,222.15	
CARVANA CO	4,496	81.210	365,120.16	
CHEWY INC - CLASS A	3,969	34.660	137,565.54	
DOLLAR GENERAL CORP	13,651	248.490	3,392,136.99	
DOLLAR TREE INC	12,839	169.850	2,180,704.15	
DOORDASH INC - A	5,953	91.250	543,211.25	
EBAY INC	35,551	53.630	1,906,600.13	
ETSY INC	7,168	102.060	731,566.08	
FIVERR INTERNATIONAL LTD	1,931	57.890	111,785.59	
GENUINE PARTS CO	7,406	134.160	993,588.96	
HOME DEPOT INC	59,526	304.940	18,151,858.44	
LKQ CORP	15,922	49.870	794,030.14	
LOWE'S COS INC	38,668	200.380	7,748,293.84	
MERCADOLIBRE INC	2,654	1,041.920	2,765,255.68	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,958	713.420	2,823,716.36	
POOL CORP	2,107	427.640	901,037.48	
ROSS STORES INC	21,189	105.610	2,237,770.29	
TARGET CORP	27,611	241.660	6,672,474.26	
TJX COMPANIES INC	66,779	63.390	4,233,120.81	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	6,117	209.960	1,284,325.32	
ULTA BEAUTY INC	2,765	418.140	1,156,157.10	
WAYFAIR INC- CLASS A	3,756	83.930	315,241.08	
COSTCO WHOLESALE CORP	25,216	568.210	14,327,983.36	
KROGER CO	38,955	56.690	2,208,358.95	
SYSCO CORP	30,220	89.740	2,711,942.80	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	40,703	45.390	1,847,509.17	
WALMART INC	87,595	156.940	13,747,159.30	
ALTRIA GROUP INC	105,961	55.230	5,852,226.03	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	32,763	90.960	2,980,122.48	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	16,130	66.930	1,079,580.90	
BUNGE LTD	7,174	116.390	834,981.86	
CAMPBELL SOUP CO	10,638	46.830	498,177.54	
COCA-COLA CO/THE	234,195	65.940	15,442,818.30	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	13,567	52.300	709,554.10	
CONAGRA BRANDS INC	24,639	36.110	889,714.29	
CONSTELLATION BRANDS INC- A	8,881	248.740	2,209,059.94	
GENERAL MILLS INC	34,440	72.200	2,486,568.00	
HERSHEY CO/THE	8,265	224.980	1,859,459.70	
HORMEL FOODS CORP	14,939	53.560	800,132.84	

JM SMUCKER CO/THE	5,768	142.210	820,267.28	
KELLOGG CO	12,949	69.260	896,847.74	
KEURIG DR PEPPER INC	38,244	37.300	1,426,501.20	
KRAFT HEINZ CO/THE	38,438	43.040	1,654,371.52	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	13,084	102.370	1,339,409.08	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	9,629	54.440	524,202.76	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	80,596	65.780	5,301,604.88	
MONSTER BEVERAGE CORP	22,202	86.680	1,924,469.36	
PEPSICO INC	78,962	173.740	13,718,857.88	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	89,277	102.530	9,153,570.81	
TYSON FOODS INC-CL A	16,951	94.510	1,602,039.01	
CHURCH & DWIGHT CO INC	14,330	104.030	1,490,749.90	
CLOROX COMPANY	6,542	152.290	996,281.18	
COLGATE-PALMOLIVE CO	46,642	81.810	3,815,782.02	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	12,953	268.220	3,474,253.66	
KIMBERLY-CLARK CORP	19,856	143.480	2,848,938.88	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	137,834	162.550	22,404,916.70	
ABBOTT LABORATORIES	101,062	120.010	12,128,450.62	
ABIOMED INC	2,288	302.140	691,296.32	
ALIGN TECHNOLOGY INC	4,154	368.860	1,532,244.44	
AMERISOURCEBERGEN CORP	9,459	158.470	1,498,967.73	
ANTHEM INC	13,954	506.870	7,072,863.98	
BAXTER INTERNATIONAL INC	29,602	72.910	2,158,281.82	
BECTON DICKINSON AND CO	15,743	258.460	4,068,935.78	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	79,811	44.590	3,558,772.49	
CARDINAL HEALTH INC	15,114	61.240	925,581.36	
CENTENE CORP	31,798	84.860	2,698,378.28	
CERNER CORP	15,537	93.810	1,457,525.97	
CIGNA CORP	19,185	254.360	4,879,896.60	
COOPER COS INC/THE	2,771	394.060	1,091,940.26	
CVS HEALTH CORP	75,780	101.770	7,712,130.60	
DAVITA INC	4,138	112.540	465,690.52	
DENTSPLY SIRONA INC	11,864	41.530	492,711.92	
DEXCOM INC	5,440	442.490	2,407,145.60	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	36,200	119.800	4,336,760.00	
HCA HEALTHCARE INC	13,853	210.500	2,916,056.50	
HENRY SCHEIN INC	7,559	87.990	665,116.41	
HOLOGIC INC	13,592	72.730	988,546.16	
HUMANA INC	7,201	441.530	3,179,457.53	

IDEXX LABORATORIES INC	4,980	472.270	2,351,904.60	
INMODE LTD	4,416	28.320	125,061.12	
INSULET CORP	4,263	251.390	1,071,675.57	
INTUITIVE SURGICAL INC	20,553	255.120	5,243,481.36	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	5,783	264.100	1,527,290.30	
MASIMO CORP	2,941	123.790	364,066.39	
MCKESSON CORP	8,411	317.310	2,668,894.41	
MEDTRONIC PLC	77,105	109.480	8,441,455.40	
MOLINA HEALTHCARE INC	3,428	326.720	1,119,996.16	
NOVOCURE LTD	4,517	83.330	376,401.61	
QUEST DIAGNOSTICS INC	6,814	136.620	930,928.68	
RESMED INC	8,650	225.950	1,954,467.50	
STERIS PLC	5,282	238.160	1,257,961.12	
STRYKER CORP	18,845	253.830	4,783,426.35	
TELADOC HEALTH INC	7,496	60.560	453,957.76	
TELEFLEX INC	2,340	326.350	763,659.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	53,590	524.270	28,095,629.30	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,203	138.760	583,208.28	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	7,675	184.100	1,412,967.50	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	12,580	127.810	1,607,849.80	
10X GENOMICS INC-CLASS A	3,814	55.050	209,960.70	
ABBVIE INC	100,824	156.300	15,758,791.20	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	16,873	121.450	2,049,225.85	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,810	162.070	1,103,696.70	
AMGEN INC	32,328	252.170	8,152,151.76	
AVANTOR INC	30,428	30.390	924,706.92	
BIOGEN INC	7,987	214.540	1,713,530.98	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	9,080	81.880	743,470.40	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,220	529.950	646,539.00	
BIO-TECHNE CORP	1,991	400.910	798,211.81	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	127,148	76.050	9,669,605.40	
CATALENT INC	8,935	90.140	805,400.90	
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,577	253.340	652,857.18	
DANAHER CORP	36,787	260.460	9,581,542.02	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	20,811	25.740	535,675.14	
ELI LILLY & CO	46,434	285.200	13,242,976.80	
EXACT SCIENCES CORP	9,771	62.640	612,055.44	
GILEAD SCIENCES INC	72,708	62.650	4,555,156.20	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	11,582	106.700	1,235,799.40	

ILLUMINA INC	8,237	319.100	2,628,426.70	
INCYTE CORP	9,243	76.560	707,644.08	
IQVIA HOLDINGS INC	10,637	219.860	2,338,650.82	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,089	166.140	679,346.46	
JOHNSON & JOHNSON	149,808	186.010	27,865,786.08	
MERCK & CO. INC.	144,374	85.440	12,335,314.56	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,258	1,302.590	1,638,658.22	
MODERNA INC	20,087	150.410	3,021,285.67	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	4,186	93.760	392,479.36	
NOVAVAX INC	3,601	50.210	180,806.21	
PERKINELMER INC	6,979	149.530	1,043,569.87	
PFIZER INC	320,083	48.950	15,668,062.85	
REGENERON PHARMACEUTICALS	5,867	690.330	4,050,166.11	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	18,344	42.310	776,134.64	
SEAGEN INC	7,790	138.540	1,079,226.60	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	60,344	9.130	550,940.72	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	22,503	544.160	12,245,232.48	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	14,163	271.680	3,847,803.84	
VIATRIS INC	63,072	10.390	655,318.08	
WATERS CORP	3,425	296.200	1,014,485.00	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	4,241	348.950	1,479,896.95	
ZOETIS INC	27,326	180.300	4,926,877.80	
BANK OF AMERICA CORP	419,938	37.290	15,659,488.02	
CITIGROUP INC	114,274	51.130	5,842,829.62	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	25,225	41.680	1,051,378.00	
FIFTH THIRD BANCORP	37,150	38.800	1,441,420.00	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	670	639.500	428,465.00	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	9,688	156.440	1,515,590.72	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	75,817	13.900	1,053,856.30	
JPMORGAN CHASE & CO	168,263	126.770	21,330,700.51	
KEYCORP	51,128	20.630	1,054,770.64	
M & T BANK CORP	10,715	174.000	1,864,410.00	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	24,474	172.500	4,221,765.00	
REGIONS FINANCIAL CORP	58,274	21.600	1,258,718.40	
SIGNATURE BANK	3,256	261.060	850,011.36	
SVB FINANCIAL GROUP	3,496	543.310	1,899,411.76	
TRUIST FINANCIAL CORP	74,318	50.840	3,778,327.12	



US BANCORP	78,364	50.840	3,984,025.76	
WEBSTER FINANCIAL CORP	9,600	50.080	480,768.00	
WELLS FARGO & CO	228,028	45.830	10,450,523.24	
ALLY FINANCIAL INC	20,139	42.040	846,643.56	
AMERICAN EXPRESS CO	37,834	184.100	6,965,239.40	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,380	280.960	1,792,524.80	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	19,982	54.390	1,086,820.98	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	44,547	44.370	1,976,550.39	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	74,178	336.950	24,994,277.10	
BLACKROCK INC	8,737	668.280	5,838,762.36	
BLACKSTONE INC	38,948	112.520	4,382,428.96	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	23,654	136.460	3,227,824.84	
CARLYLE GROUP INC/THE	10,094	40.650	410,321.10	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	5,661	115.270	652,543.47	
CME GROUP INC	20,739	221.560	4,594,932.84	
COINBASE GLOBAL INC - CLASS A	2,027	135.140	273,928.78	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	16,425	112.640	1,850,112.00	
EQUITABLE HOLDINGS INC	22,820	30.190	688,935.80	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,939	429.040	831,908.56	
FRANKLIN RESOURCES INC	14,298	26.630	380,755.74	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	3,159	32.100	101,403.90	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	19,406	321.420	6,237,476.52	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	32,658	116.850	3,816,087.30	
INVESCO LTD	18,328	20.790	381,039.12	
KKR & CO INC	28,569	53.000	1,514,157.00	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,912	267.950	512,320.40	
MOODY'S CORP	9,247	325.510	3,009,990.97	
MORGAN STANLEY	77,387	85.050	6,581,764.35	
MSCI INC	4,862	462.300	2,247,702.60	
NASDAQ INC	6,509	166.640	1,084,659.76	
NORTHERN TRUST CORP	11,023	105.760	1,165,792.48	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	9,639	103.970	1,002,166.83	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	9,737	10.390	101,167.43	
S&P GLOBAL INC	20,313	381.220	7,743,721.86	
SCHWAB (CHARLES) CORP	83,280	70.310	5,855,416.80	
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,481	56.900	311,868.90	

SOFI TECHNOLOGIES INC	27,739	6.550	181,690.45	
STATE STREET CORP	20,939	70.950	1,485,622.05	
SYNCHRONY FINANCIAL	32,112	38.290	1,229,568.48	
T ROWE PRICE GROUP INC	12,314	137.190	1,689,357.66	
TRADEWEB MARKETS INC- CLASS A	5,220	79.740	416,242.80	
UPSTART HOLDINGS INC	1,590	79.590	126,548.10	
AFLAC INC	34,185	62.400	2,133,144.00	
ALLEGHANY CORP	689	837.000	576,693.00	
ALLSTATE CORP	16,419	131.820	2,164,352.58	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,539	143.770	508,802.03	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	48,577	59.680	2,899,075.36	
AON PLC-CLASS A	12,782	321.440	4,108,646.08	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	20,476	46.730	956,843.48	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	12,291	178.890	2,198,736.99	
ASSURANT INC	3,114	187.160	582,816.24	
BROWN & BROWN INC	14,273	68.450	976,986.85	
CHUBB LTD	24,864	207.320	5,154,804.48	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	9,371	136.080	1,275,205.68	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,288	173.810	223,867.28	
EVEREST RE GROUP LTD	2,065	284.240	586,955.60	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	13,937	40.960	570,859.52	
GLOBE LIFE INC	6,373	102.030	650,237.19	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	18,331	71.400	1,308,833.40	
LINCOLN NATIONAL CORP	8,677	64.310	558,017.87	
LOEWS CORP	12,727	64.680	823,182.36	
MARKEL CORP	702	1,451.370	1,018,861.74	
MARSH & MCLENNAN COS	28,143	171.700	4,832,153.10	
METLIFE INC	39,703	69.080	2,742,683.24	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	14,124	71.850	1,014,809.40	
PROGRESSIVE CORP	32,839	110.560	3,630,679.84	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	20,728	113.990	2,362,784.72	
TRAVELERS COS INC/THE	14,464	174.440	2,523,100.16	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,823	241.060	1,644,752.38	
WR BERKLEY CORP	11,142	67.900	756,541.80	
CBRE GROUP INC - A	18,244	84.660	1,544,537.04	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	79,100	4.600	363,860.00	
ZILLOW GROUP INC - A	3,154	42.210	133,130.34	
ZILLOW GROUP INC - C	10,672	43.940	468,927.68	

ACCENTURE PLC-CL A	36,095	316.820	11,435,617.90	
ADOBE INC	27,186	413.950	11,253,644.70	
AFFIRM HOLDINGS INC	9,077	32.470	294,730.19	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	8,321	118.760	988,201.96	
ANSYS INC	4,983	282.160	1,406,003.28	
ASANA INC - CL A	4,435	30.540	135,444.90	
AUTODESK INC	12,331	191.150	2,357,070.65	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	23,443	227.060	5,322,967.58	
AVALARA INC	4,319	83.860	362,191.34	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	8,808	43.320	381,562.56	
BILL.COM HOLDINGS INC	4,158	182.900	760,498.20	
BLACK KNIGHT INC	7,623	67.460	514,247.58	
BLOCK INC	29,496	107.380	3,167,280.48	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	5,889	151.040	889,474.56	
CADENCE DESIGN SYS INC	15,400	151.100	2,326,940.00	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	6,979	58.600	408,969.40	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	5,880	138.860	816,496.80	
CITRIX SYSTEMS INC	6,490	101.290	657,372.10	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	14,179	98.710	1,399,609.09	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS- A	29,348	84.460	2,478,732.08	
COUPA SOFTWARE INC	3,490	92.760	323,732.40	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	10,656	214.580	2,286,564.48	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,795	164.670	460,252.65	
DATADOG INC - CLASS A	11,914	121.680	1,449,695.52	
DOCUSIGN INC	12,031	89.950	1,082,188.45	
DROPBOX INC-CLASS A	16,584	22.550	373,969.20	
DYNATRACE INC	9,587	41.020	393,258.74	
EPAM SYSTEMS INC	3,095	280.070	866,816.65	
FAIR ISAAC CORP	1,494	386.500	577,431.00	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	33,940	99.220	3,367,526.80	
FISERV INC	33,818	97.950	3,312,473.10	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,371	251.880	1,100,967.48	
FORTINET INC	8,155	323.490	2,638,060.95	
GARTNER INC	4,568	298.200	1,362,177.60	
GLOBAL PAYMENTS INC	17,139	135.730	2,326,276.47	
GODADDY INC - CLASS A	8,905	87.410	778,386.05	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	4,731	90.860	429,858.66	
HUBSPOT INC	2,561	401.300	1,027,729.30	

INTL BUSINESS MACHINES CORP	51,574	139.100	7,173,943.40	
INTUIT INC	15,449	446.930	6,904,621.57	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,915	197.450	773,016.75	
MASTERCARD INC - A	50,005	354.600	17,731,773.00	
MICROSOFT CORP	404,747	280.720	113,620,577.84	
MONGODB INC	3,155	381.740	1,204,389.70	
NORTONLIFELOCK INC	31,347	25.870	810,946.89	
OKTA INC	8,044	138.400	1,113,289.60	
ORACLE CORP	94,141	76.980	7,246,974.18	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	98,735	12.110	1,195,680.85	
PALO ALTO NETWORKS INC	5,746	599.730	3,446,048.58	
PAYCHEX INC	17,729	132.250	2,344,660.25	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,007	303.460	912,504.22	
PAYPAL HOLDINGS INC	64,104	87.780	5,627,049.12	
PTC INC	5,462	99.900	545,653.80	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,992	92.430	368,980.56	
SALESFORCE INC	55,955	174.570	9,768,064.35	
SERVICENOW INC	11,453	472.270	5,408,908.31	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	11,562	186.940	2,161,400.28	
SPLUNK INC	9,792	129.000	1,263,168.00	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	11,546	68.890	795,403.94	
SYNOPSIS INC	8,565	290.920	2,491,729.80	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	24,100	63.020	1,518,782.00	
TWILIO INC - A	8,993	128.070	1,151,733.51	
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,406	396.450	953,858.70	
UNITY SOFTWARE INC	2,853	79.420	226,585.26	
VERISIGN INC	5,227	211.170	1,103,785.59	
VISA INC-CLASS A SHARES	95,103	209.950	19,966,874.85	
VMWARE INC-CLASS A	12,723	110.170	1,401,692.91	
WESTERN UNION CO	21,840	19.130	417,799.20	
WIX.COM LTD	3,194	82.830	264,559.02	
WORKDAY INC-CLASS A	10,736	209.130	2,245,219.68	
ZENDESK INC	6,067	121.970	739,991.99	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	12,049	102.440	1,234,299.56	
ZSCALER INC	4,551	216.790	986,611.29	
AMPHENOL CORP-CL A	35,157	70.710	2,485,951.47	
APPLE INC	930,837	162.880	151,614,730.56	
ARISTA NETWORKS INC	12,952	118.940	1,540,510.88	
ARROW ELECTRONICS INC	4,130	114.590	473,256.70	

CDW CORP/DE	7,404	170.650	1,263,492.60	
CISCO SYSTEMS INC	240,838	51.940	12,509,125.72	
COGNEX CORP	8,698	70.750	615,383.50	
CORNING INC	45,688	34.420	1,572,580.96	
DELL TECHNOLOGIES -C	14,550	47.270	687,778.50	
F5 INC	3,921	203.000	795,963.00	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	71,283	15.590	1,111,301.97	
HP INC	65,388	37.000	2,419,356.00	
IPG PHOTONICS CORP	1,776	96.850	172,005.60	
JUNIPER NETWORKS INC	17,460	34.620	604,465.20	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	11,039	146.960	1,622,291.44	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	9,212	225.050	2,073,160.60	
NETAPP INC	13,273	77.400	1,027,330.20	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	11,800	82.540	973,972.00	
TE CONNECTIVITY LTD	19,220	124.400	2,390,968.00	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,844	468.680	1,332,925.92	
TRIMBLE INC	12,759	68.470	873,608.73	
WESTERN DIGITAL CORP	18,492	51.010	943,276.92	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP- CL A	3,257	388.940	1,266,777.58	
ADVANCED MICRO DEVICES	93,559	90.690	8,484,865.71	
ANALOG DEVICES INC	30,985	158.920	4,924,136.20	
APPLIED MATERIALS INC	51,912	114.470	5,942,366.64	
BROADCOM INC	23,489	587.880	13,808,713.32	
ENPHASE ENERGY INC	7,293	157.600	1,149,376.80	
ENTEGRIS INC	7,892	114.590	904,344.28	
INTEL CORP	232,509	47.060	10,941,873.54	
KLA CORP	8,854	331.210	2,932,533.34	
LAM RESEARCH CORP	7,779	476.420	3,706,071.18	
MARVELL TECHNOLOGY INC	45,111	60.690	2,737,786.59	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	30,238	68.100	2,059,207.80	
MICRON TECHNOLOGY INC	64,636	70.120	4,532,276.32	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,676	420.170	1,124,374.92	
NVIDIA CORP	142,103	199.020	28,281,339.06	
NXP SEMICONDUCTORS NV	14,457	172.840	2,498,747.88	
ON SEMICONDUCTOR	24,630	53.480	1,317,212.40	
QORVO INC	6,042	114.610	692,473.62	
QUALCOMM INC	64,123	136.560	8,756,636.88	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,757	117.880	1,032,275.16	
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	2,634	253.490	667,692.66	

TERADYNE INC	8,542	112.570	961,572.94	
TEXAS INSTRUMENTS INC	52,879	173.910	9,196,186.89	
AT&T INC	408,894	19.510	7,977,521.94	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	21,079	24.980	526,553.42	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	8,432	23.980	202,199.36	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	49,758	10.870	540,869.46	
T-MOBILE US INC	36,145	128.810	4,655,837.45	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	236,606	50.280	11,896,549.68	
AES CORP	33,656	22.080	743,124.48	
ALLIANT ENERGY CORP	13,644	62.070	846,883.08	
AMEREN CORPORATION	14,760	95.920	1,415,779.20	
AMERICAN ELECTRIC POWER	27,967	100.500	2,810,683.50	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	10,241	160.810	1,646,855.21	
ATMOS ENERGY CORP	6,965	117.700	819,780.50	
CENTERPOINT ENERGY INC	37,091	31.750	1,177,639.25	
CMS ENERGY CORP	16,996	70.590	1,199,747.64	
CONSOLIDATED EDISON INC	21,051	96.050	2,021,948.55	
CONSTELLATION ENERGY	18,329	62.270	1,141,346.83	
DOMINION ENERGY INC	47,030	84.560	3,976,856.80	
DTE ENERGY COMPANY	10,536	135.700	1,429,735.20	
DUKE ENERGY CORP	44,466	113.770	5,058,896.82	
EDISON INTERNATIONAL	21,701	71.270	1,546,630.27	
ENERGY CORP	10,866	122.240	1,328,259.84	
ESSENTIAL UTILITIES INC	13,909	47.510	660,816.59	
EVERGY INC	14,377	70.100	1,007,827.70	
EVERSOURCE ENERGY	19,764	90.690	1,792,397.16	
EXELON CORP	54,987	48.770	2,681,715.99	
FIRSTENERGY CORP	31,966	45.440	1,452,535.04	
NEXTERA ENERGY INC	112,369	74.040	8,319,800.76	
NISOURCE INC	18,919	30.580	578,543.02	
NRG ENERGY INC	13,547	37.610	509,502.67	
P G & E CORP	76,538	11.820	904,679.16	
PPL CORP	39,561	29.760	1,177,335.36	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	27,231	72.640	1,978,059.84	
SEMPRA ENERGY	18,666	165.380	3,086,983.08	
SOUTHERN CO/THE	61,390	74.970	4,602,408.30	
UGI CORP	10,588	36.290	384,238.52	
VISTRA CORP	25,777	25.010	644,682.77	
WEC ENERGY GROUP INC	18,827	102.910	1,937,486.57	
XCEL ENERGY INC	29,237	73.700	2,154,766.90	
ACTIVISION BLIZZARD INC	43,065	78.050	3,361,223.25	

ALPHABET INC-CL A	17,091	2,461.480	42,069,154.68	
ALPHABET INC-CL C	16,249	2,465.000	40,053,785.00	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	27,658	16.960	469,079.68	
CABLE ONE INC	246	1,356.120	333,605.52	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,002	506.970	3,549,803.94	
COMCAST CORP-CLASS A	260,545	45.710	11,909,511.95	
DISH NETWORK CORP-A	12,937	31.490	407,386.13	
ELECTRONIC ARTS INC	15,352	128.150	1,967,358.80	
FOX CORP - CLASS A	16,962	37.990	644,386.38	
FOX CORP - CLASS B	8,773	35.180	308,634.14	
IAC/INTERACTIVECORP	3,974	89.580	355,990.92	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	19,626	35.080	688,480.08	
LIBERTY BROADBAND-A	1,312	123.050	161,441.60	
LIBERTY BROADBAND-C	8,196	128.160	1,050,399.36	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	10,288	66.630	685,489.44	
LIBERTY MEDIA COR- SIRIUSXM A	4,141	43.790	181,334.39	
LIBERTY MEDIA COR- SIRIUSXM C	7,648	43.830	335,211.84	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	8,770	109.680	961,893.60	
MATCH GROUP INC	15,249	82.480	1,257,737.52	
META PLATFORMS INC-CLASS A	134,599	186.990	25,168,667.01	
NETFLIX INC	25,368	209.910	5,324,996.88	
NEWS CORP - CLASS A	23,102	20.880	482,369.76	
OMNICOM GROUP	12,545	79.100	992,309.50	
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	32,381	31.200	1,010,287.20	
PINTEREST INC- CLASS A	28,563	20.000	571,260.00	
ROKU INC	6,012	101.410	609,676.92	
SEA LTD-ADR	18,531	89.520	1,658,895.12	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	67,656	6.170	417,437.52	
SNAP INC - A	64,099	29.910	1,917,201.09	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	7,149	132.960	950,531.04	
TWITTER INC	45,558	51.700	2,355,348.60	
WALT DISNEY CO/THE	103,753	119.950	12,445,172.35	
WARNER BROS DISCOVERY INC	123,410	21.500	2,653,315.00	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	15,382	50.940	783,559.08	
アメリカ・ドル小計	18,020,800		2,118,946,404.42 (270,377,561,204)	

カナダ・ ドル	CAMECO CORP	18,890	34.340	648,682.60	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	68,240	78.050	5,326,132.00	
	CENOVUS ENERGY INC	75,060	20.940	1,571,756.40	
	ENBRIDGE INC	116,715	56.180	6,557,048.70	
	IMPERIAL OIL LTD	12,999	59.400	772,140.60	
	KEYERA CORP	11,374	31.630	359,759.62	
	PARKLAND CORP	7,666	34.000	260,644.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	32,172	47.950	1,542,647.40	
	SUNCOR ENERGY INC	85,505	39.780	3,401,388.90	
	TC ENERGY CORP	53,918	71.160	3,836,804.88	
	TOURMALINE OIL CORP	16,638	63.250	1,052,353.50	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	27,243	73.140	1,992,553.02	
	BARRICK GOLD CORP	102,105	28.940	2,954,918.70	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	8,705	56.520	492,006.60	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	31,672	35.370	1,120,238.64	
	FRANCO-NEVADA CORP	11,432	198.040	2,263,993.28	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	32,698	10.610	346,925.78	
	KINROSS GOLD CORP	63,501	6.750	428,631.75	
	LUNDIN MINING CORP	46,446	12.010	557,816.46	
	NUTRIEN LTD	33,270	126.710	4,215,641.70	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	11,763	32.420	381,356.46	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	24,814	45.670	1,133,255.38	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,438	110.700	491,286.60	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	24,335	59.280	1,442,578.80	
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	17,008	11.570	196,782.56	
	CAE INC	17,963	33.750	606,251.25	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,843	119.760	460,237.68	
	WSP GLOBAL INC	6,141	155.770	956,583.57	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	9,913	39.320	389,779.16	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	5,667	71.840	407,117.28	
	THOMSON REUTERS CORP	9,710	131.950	1,281,234.50	
	AIR CANADA	12,083	24.220	292,650.26	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	40,807	158.090	6,451,178.63	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	53,134	94.880	5,041,353.92	
TFI INTERNATIONAL INC	5,097	109.420	557,713.74		
MAGNA INTERNATIONAL INC	16,331	79.430	1,297,171.33		
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,066	45.350	411,143.10		
RESTAURANT BRANDS INTERN	17,686	74.720	1,321,497.92		
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	3,001	182.400	547,382.40		



DOLLARAMA INC	17,025	74.630	1,270,575.75	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	48,248	56.970	2,748,688.56	
EMPIRE CO LTD 'A'	9,148	42.770	391,259.96	
LOBLAW COMPANIES LTD	8,683	117.150	1,017,213.45	
METRO INC/CN	13,109	70.240	920,776.16	
WESTON (GEORGE) LTD	4,984	159.000	792,456.00	
SAPUTO INC	13,425	30.190	405,300.75	
BAUSCH HEALTH COS INC	16,447	27.320	449,332.04	
CANOPY GROWTH CORP	11,251	7.070	79,544.57	
BANK OF MONTREAL	36,684	141.440	5,188,584.96	
BANK OF NOVA SCOTIA	68,902	84.930	5,851,846.86	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	26,066	143.830	3,749,072.78	
NATIONAL BANK OF CANADA	19,626	92.190	1,809,320.94	
ROYAL BANK OF CANADA	80,808	131.600	10,634,332.80	
TORONTO-DOMINION BANK	104,525	93.060	9,727,096.50	
BROOKFIELD ASSET MANAGE- CL A	80,030	65.940	5,277,178.20	
IGM FINANCIAL INC	4,949	41.470	205,235.03	
ONEX CORPORATION	4,217	77.560	327,070.52	
TMX GROUP LTD	3,142	131.090	411,884.78	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,393	681.020	948,660.86	
GREAT-WEST LIFECO INC	14,200	36.170	513,614.00	
IA FINANCIAL CORP INC	4,851	71.710	347,865.21	
INTACT FINANCIAL CORP	10,095	179.990	1,816,999.05	
MANULIFE FINANCIAL CORP	110,844	25.760	2,855,341.44	
POWER CORP OF CANADA	31,768	38.290	1,216,396.72	
SUN LIFE FINANCIAL INC	33,220	66.040	2,193,848.80	
FIRSTSERVICE CORP	2,516	166.660	419,316.56	
BLACKBERRY LTD	25,993	7.730	200,925.89	
CGI INC	11,493	103.020	1,184,008.86	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,098	2,144.640	2,354,814.72	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	6,363	29.650	188,662.95	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	5,042	77.380	390,149.96	
OPEN TEXT CORP	15,337	53.040	813,474.48	
SHOPIFY INC - CLASS A	6,582	584.240	3,845,467.68	
BCE INC	5,509	71.570	394,279.13	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	20,818	73.280	1,525,543.04	
TELUS CORP	15,222	33.310	507,044.82	

	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	44,154	19.220	848,639.88	
	ALTAGAS LTD	17,347	29.540	512,430.38	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	6,336	47.290	299,629.44	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	7,344	39.260	288,325.44	
	EMERA INC	14,279	63.820	911,285.78	
	FORTIS INC	25,895	63.360	1,640,707.20	
	HYDRO ONE LTD	18,821	35.810	673,980.01	
	NORTHLAND POWER INC	10,870	39.800	432,626.00	
	QUEBECOR INC -CL B	9,953	32.390	322,377.67	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	27,232	38.780	1,056,056.96	
	カナダ・ドル小計	2,224,893		143,327,882.61 (14,362,887,116)	
オーストラリア・ドル	AMPOL LTD	10,927	32.840	358,842.68	
	SANTOS LTD	182,883	8.150	1,490,496.45	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	14,025	27.220	381,760.50	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	54,981	32.070	1,763,240.67	
	BHP GROUP LTD	287,051	48.490	13,919,102.99	
	BLUESCOPE STEEL LTD	25,462	21.970	559,400.14	
	EVOLUTION MINING LTD	84,420	4.170	352,031.40	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	88,448	21.220	1,876,866.56	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	26,108	41.000	1,070,428.00	
	MINERAL RESOURCES LTD	11,662	60.700	707,883.40	
	NEWCREST MINING LTD	54,082	28.290	1,529,979.78	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	65,844	10.730	706,506.12	
	ORICA LTD	17,981	16.540	297,405.74	
	RIO TINTO LTD	21,049	113.600	2,391,166.40	
	SOUTH32 LTD	276,348	4.840	1,337,524.32	
	REECE LTD	19,309	17.280	333,659.52	
	BRAMBLES LTD	74,638	10.730	800,865.74	
	AURIZON HOLDINGS LTD	94,440	3.900	368,316.00	
	QANTAS AIRWAYS LTD	45,831	5.640	258,486.84	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	30,749	32.660	1,004,262.34	
CROWN RESORTS LTD	21,863	12.840	280,720.92		
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,794	80.910	306,972.54		
IDP EDUCATION LTD	10,940	27.360	299,318.40		
TABCORP HOLDINGS LTD	139,785	5.400	754,839.00		
WESFARMERS LTD	65,345	49.300	3,221,508.50		
COLES GROUP LTD	79,056	18.830	1,488,624.48		

	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	65,607	7.740	507,798.18	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	69,646	39.320	2,738,480.72	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	36,464	11.140	406,208.96	
	COCHLEAR LTD	4,095	233.170	954,831.15	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,446	84.370	796,959.02	
	SONIC HEALTHCARE LTD	24,258	36.410	883,233.78	
	CSL LTD	27,463	270.860	7,438,628.18	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	156,874	27.780	4,357,959.72	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	97,957	105.370	10,321,729.09	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	187,025	33.140	6,198,008.50	
	WESTPAC BANKING CORP	213,258	24.210	5,162,976.18	
	ASX LTD	11,180	82.530	922,685.40	
	MACQUARIE GROUP LTD	18,953	207.600	3,934,642.80	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	117,187	4.450	521,482.15	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	128,724	3.190	410,629.56	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	80,863	12.120	980,059.56	
	SUNCORP GROUP LTD	63,933	11.210	716,688.93	
	COMPUTERSHARE LTD	33,563	25.300	849,143.90	
	WISETECH GLOBAL LTD	7,909	45.860	362,706.74	
	XERO LTD	7,459	97.840	729,788.56	
	TELSTRA CORP LTD	254,603	4.050	1,031,142.15	
	ORIGIN ENERGY LTD	117,278	6.720	788,108.16	
	REA GROUP LTD	2,833	125.740	356,221.42	
	SEEK LTD	17,266	27.570	476,023.62	
	オーストラリア・ドル小計	3,560,865		89,706,345.86	
				(8,232,351,360)	
香港・ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	153,924	55.850	8,596,655.40	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	83,000	104.100	8,640,300.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	94,000	16.240	1,526,560.00	
	MTR CORP	84,500	42.100	3,557,450.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	70,000	26.450	1,851,500.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	118,000	43.200	5,097,600.00	
	SANDS CHINA LTD	142,400	16.500	2,349,600.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	117,000	12.480	1,460,160.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	89,600	19.800	1,774,080.00	
	WH GROUP LTD	581,500	5.360	3,116,840.00	

	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	187,500	29.100	5,456,250.00	
	HANG SENG BANK LTD	48,200	152.300	7,340,860.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	67,100	323.400	21,700,140.00	
	AIA GROUP LTD	694,800	75.000	52,110,000.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	126,924	53.550	6,796,780.20	
	ESR CAYMAN LTD	102,000	24.900	2,539,800.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	98,000	16.400	1,607,200.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	83,384	32.800	2,734,995.20	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	84,833	30.700	2,604,373.10	
	SINO LAND CO	248,200	10.680	2,650,776.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	68,000	93.400	6,351,200.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	27,000	43.800	1,182,600.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	53,000	19.580	1,037,740.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	91,000	37.550	3,417,050.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	41,000	54.000	2,214,000.00	
	CLP HOLDINGS LTD	94,100	77.650	7,306,865.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	606,389	8.860	5,372,606.54	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	71,500	53.450	3,821,675.00	
	香港・ドル小計	4,326,854		174,215,656.44 (2,832,746,574)	
シンガポール・ドル	KEPPEL CORP LTD	70,500	6.690	471,645.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	108,600	4.150	450,690.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	77,966	5.530	431,151.98	
	GENTING SINGAPORE LTD	327,500	0.810	265,275.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	103,200	4.470	461,304.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	102,000	33.400	3,406,800.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	202,300	11.990	2,425,577.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	64,700	30.780	1,991,466.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,800	9.850	421,580.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	136,600	4.060	554,596.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	25,800	8.480	218,784.00	
	UOL GROUP LTD	30,900	7.120	220,008.00	
	VENTURE CORP LTD	15,700	17.000	266,900.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	439,815	2.690	1,183,102.35	
	シンガポール・ドル小計	1,748,381		12,768,879.33 (1,186,995,023)	

ニュー ジーラン ド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	70,711	7.850	555,081.35	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	31,250	22.290	696,562.50	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	24,028	9.200	221,057.60	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	113,841	4.920	560,097.72	
	MERCURY NZ LTD	26,913	5.910	159,055.83	
	MERIDIAN ENERGY LTD	66,454	4.830	320,972.82	
	ニュージーランド・ドル 小計	333,197		2,512,827.82 (212,484,719)	
イギリ ス・ボン ド	BP PLC	1,097,928	3.688	4,049,158.46	
	SHELL PLC	439,968	20.745	9,127,136.16	
	ANGLO AMERICAN PLC	70,253	32.235	2,264,605.45	
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	14.450	280,893.55	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,838	75.600	592,552.80	
	GLENCORE PLC	576,604	4.493	2,590,681.77	
	JOHNSON MATTHEY PLC	10,074	18.365	185,009.01	
	MONDI PLC	25,128	14.855	373,276.44	
	RIO TINTO PLC	64,866	53.720	3,484,601.52	
	ASHTREAD GROUP PLC	23,686	43.940	1,040,762.84	
	BAE SYSTEMS PLC	189,839	7.322	1,390,001.15	
	BUNZL PLC	17,064	30.380	518,404.32	
	DCC PLC	5,954	59.300	353,072.20	
	FERGUSON PLC	12,017	102.050	1,226,334.85	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	221,714	1.203	266,721.94	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	494,144	0.868	428,916.99	
	SMITHS GROUP PLC	24,369	14.500	353,350.50	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	4,459	122.650	546,896.35	
	EXPERIAN PLC	54,749	27.530	1,507,239.97	
	INTERTEK GROUP PLC	8,184	50.660	414,601.44	
	RELX PLC	106,284	24.050	2,556,130.20	
	RENTOKIL INITIAL PLC	112,603	5.324	599,498.37	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,766	5.102	330,436.13	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,637	40.810	270,855.97	
	BURBERRY GROUP PLC	26,233	15.580	408,710.14	
	PERSIMMON PLC	16,916	21.940	371,137.04	
	TAYLOR WIMPEY PLC	225,588	1.280	288,752.64	
COMPASS GROUP PLC	97,177	16.995	1,651,523.11		
ENTAIN PLC	37,600	14.690	552,344.00		
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	9,587	50.680	485,869.16		
WHITBREAD PLC	11,282	27.900	314,767.80		
JD SPORTS FASHION PLC	144,300	1.404	202,597.20		

KINGFISHER PLC	109,678	2.559	280,666.00	
NEXT PLC	6,860	61.280	420,380.80	
OCADO GROUP PLC	27,379	10.360	283,646.44	
SAINSBURY (J) PLC	113,480	2.434	276,210.32	
TESCO PLC	439,670	2.686	1,180,953.62	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	16,771	16.300	273,367.30	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	125,847	32.770	4,124,006.19	
COCA-COLA HBC AG-DI	8,704	16.385	142,615.04	
DIAGEO PLC	134,031	39.390	5,279,481.09	
IMPERIAL BRANDS PLC	50,003	16.225	811,298.67	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	40,047	63.160	2,529,368.52	
UNILEVER PLC	147,693	36.065	5,326,548.04	
NMC HEALTH PLC	3,940	0.010	39.40	
SMITH & NEPHEW PLC	44,355	12.665	561,756.07	
ASTRAZENECA PLC	88,548	102.340	9,062,002.32	
GLAXOSMITHKLINE PLC	289,657	17.392	5,037,714.54	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	7,581	20.390	154,576.59	
BARCLAYS PLC	904,741	1.441	1,303,731.78	
HSBC HOLDINGS PLC	1,167,394	5.016	5,855,648.30	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,178,120	0.454	1,896,866.48	
NATWEST GROUP PLC	316,287	2.182	690,138.23	
STANDARD CHARTERED PLC	146,561	4.973	728,847.85	
3I GROUP PLC	49,338	13.185	650,521.53	
ABRDN PLC	123,263	1.915	236,048.64	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	19,572	9.788	191,570.73	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	17,716	80.680	1,429,326.88	
M&G PLC	133,064	2.114	281,297.29	
SCHRODERS PLC	6,213	29.660	184,277.58	
ST JAMES' S PLACE PLC	33,823	13.165	445,279.79	
ADMIRAL GROUP PLC	11,535	25.090	289,413.15	
AVIVA PLC	229,027	4.288	982,067.77	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	313,637	2.525	791,933.42	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	36,851	6.110	225,159.61	
PRUDENTIAL PLC	161,840	9.892	1,600,921.28	
AVEVA GROUP PLC	6,037	23.810	143,740.97	
SAGE GROUP PLC/THE	55,987	7.258	406,353.64	
HALMA PLC	24,375	24.770	603,768.75	
BT GROUP PLC	545,432	1.882	1,026,503.02	
VODAFONE GROUP PLC	1,546,057	1.267	1,958,854.21	

	NATIONAL GRID PLC	199,260	11.810	2,353,260.60	
	SEVERN TRENT PLC	12,418	30.530	379,121.54	
	SSE PLC	64,516	18.275	1,179,029.90	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	42,035	11.325	476,046.37	
	AUTO TRADER GROUP PLC	51,319	6.324	324,541.35	
	INFORMA PLC	78,152	5.848	457,032.89	
	PEARSON PLC	39,623	7.874	311,991.50	
	WPP PLC	63,987	10.005	640,189.93	
	イギリス・ポンド小計	16,459,674		102,814,955.40 (16,721,824,346)	
イスラエル・シュケル	ICL GROUP LTD	41,773	36.920	1,542,259.16	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,389	721.500	1,002,163.50	
	BANK HAPOALIM BM	66,403	30.970	2,056,500.91	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	77,079	35.420	2,730,138.18	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	54,674	19.500	1,066,143.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	9,249	122.900	1,136,702.10	
	AZRIELI GROUP LTD	2,140	288.100	616,534.00	
	NICE LTD	3,251	669.100	2,175,244.10	
	イスラエル・シュケル小計	255,958		12,325,684.95 (478,884,907)	
スイス・フラン	CLARIANT AG-REG	10,101	15.460	156,161.46	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	356	854.500	304,202.00	
	GIVAUDAN-REG	521	3,866.000	2,014,186.00	
	HOLCIM LTD	31,603	48.280	1,525,792.84	
	SIKA AG-REG	7,800	299.500	2,336,100.00	
	ABB LTD-REG	96,015	29.250	2,808,438.75	
	GEBERIT AG-REG	1,986	554.200	1,100,641.20	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	941	187.400	176,343.40	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,132	188.500	401,882.00	
	VAT GROUP AG	1,436	316.600	454,637.60	
	ADECCO GROUP AG-REG	9,118	39.130	356,787.34	
	SGS SA-REG	374	2,520.000	942,480.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG- REG	2,981	277.600	827,525.60	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	30,335	110.100	3,339,883.50	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,716	245.100	420,591.60	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	2,516	47.200	118,755.20	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	216	2,240.000	483,840.00		
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT- PC	59	10,780.000	636,020.00		

	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	6	112,100.000	672,600.00	
	NESTLE SA-REG	160,218	125.860	20,165,037.48	
	ALCON INC	29,513	73.900	2,181,010.70	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,269	354.400	1,158,533.60	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	5,310	118.550	629,500.50	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	322	440.000	141,680.00	
	LONZA GROUP AG-REG	4,343	592.000	2,571,056.00	
	NOVARTIS AG-REG	125,305	85.920	10,766,205.60	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,921	392.800	754,568.80	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	40,075	364.300	14,599,322.50	
	VIFOR PHARMA AG	2,638	171.350	452,021.30	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	145,488	6.726	978,552.28	
	JULIUS BAER GROUP LTD	12,550	45.970	576,923.50	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,203	1,076.500	1,295,029.50	
	UBS GROUP AG-REG	204,228	16.240	3,316,662.72	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,475	168.100	416,047.50	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,834	595.000	1,091,230.00	
	SWISS RE AG	16,690	78.900	1,316,841.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	8,712	436.700	3,804,530.40	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,906	95.200	371,851.20	
	TEMENOS AG - REG	3,743	87.080	325,940.44	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	10,426	63.420	661,216.92	
	SWISSCOM AG-REG	1,399	561.000	784,839.00	
	スイス・フラン小計	985,780		87,435,469.43 (11,656,022,430)	
デンマーク・クローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	5,509	539.400	2,971,554.60	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	11,512	457.800	5,270,193.60	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	513	1,985.000	1,018,305.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	60,424	189.680	11,461,224.32	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	168	17,740.000	2,980,320.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	311	18,155.000	5,646,205.00	
	DSV A/S	11,866	1,129.500	13,402,647.00	
	PANDORA A/S	5,888	635.200	3,740,057.60	
	CARLSBERG AS-B	5,585	879.800	4,913,683.00	
	AMBU A/S-B	8,356	102.300	854,818.80	
	COLOPLAST-B	6,399	1,001.500	6,408,598.50	
	DEMANT A/S	8,178	298.000	2,437,044.00	
	GN STORE NORD A/S	6,484	275.600	1,786,990.40	
	GENMAB A/S	3,688	2,504.000	9,234,752.00	
NOVO NORDISK A/S-B	96,328	778.100	74,952,816.80		



	DANSKE BANK A/S	39,103	117.000	4,575,051.00	
	TRYG A/S	16,989	168.000	2,854,152.00	
	ORSTED A/S	10,423	836.600	8,719,881.80	
	デンマーク・クローネ小計	297,724		163,228,295.42	
				(3,003,400,636)	
ノルウェー・クローネ	AKER BP ASA	6,316	330.000	2,084,280.00	
	EQUINOR ASA	55,409	313.800	17,387,344.20	
	NORSK HYDRO ASA	83,294	76.400	6,363,661.60	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,005	462.500	4,164,812.50	
	MOWI ASA	23,318	253.800	5,918,108.40	
	ORKLA ASA	46,955	75.780	3,558,249.90	
	DNB BANK ASA	52,746	195.500	10,311,843.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,412	213.000	2,430,756.00	
	TELENOR ASA	40,694	131.000	5,330,914.00	
	ADEVINTA ASA	15,540	70.250	1,091,685.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	5,480	178.500	978,180.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	3,338	196.600	656,250.80	
	ノルウェー・クローネ小計	353,507		60,276,085.40	
				(844,467,956)	
スウェーデン・クローナ	LUNDIN ENERGY AB	13,316	400.500	5,333,058.00	
	BOLIDEN AB	15,297	430.000	6,577,710.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	34,370	185.650	6,380,790.50	
	ALFA LAVAL AB	18,697	310.700	5,809,157.90	
	ASSA ABLOY AB-B	60,292	251.100	15,139,321.20	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	37,342	462.600	17,274,409.20	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	22,320	402.500	8,983,800.00	
	EPIROC AB-A	34,230	198.650	6,799,789.50	
	EPIROC AB-B	19,836	168.150	3,335,423.40	
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	89.980	1,672,998.14	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,223	265.800	2,185,673.40	
	LIFCO AB-B SHS	15,149	210.100	3,182,804.90	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	89,271	102.000	9,105,642.00	
	SANDVIK AB	61,070	194.550	11,881,168.50	
	SKANSKA AB-B SHS	17,183	192.500	3,307,727.50	
	SKF AB-B SHARES	20,607	157.500	3,245,602.50	
	VOLVO AB-A SHS	13,283	163.400	2,170,442.20	
	VOLVO AB-B SHS	80,338	158.920	12,767,314.96	
	SECURITAS AB-B SHS	16,123	115.250	1,858,175.75	
	ELECTROLUX AB-B	11,555	153.320	1,771,612.60	
EVOLUTION AB	10,669	925.800	9,877,360.20		
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	40,148	125.620	5,043,391.76		

	SWEDISH MATCH AB	84,640	75.880	6,422,483.20	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	36,076	260.600	9,401,405.60	
	GETINGE AB-B SHS	13,151	343.900	4,522,628.90	
	NORDEA BANK ABP	184,357	99.000	18,251,343.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	100,891	106.800	10,775,158.80	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	77,668	93.580	7,268,171.44	
	SWEDBANK AB - A SHARES	57,603	156.700	9,026,390.10	
	EQT AB	15,443	323.000	4,988,089.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	7,211	245.700	1,771,742.70	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,642	239.000	2,543,438.00	
	INVESTOR AB-A SHS	27,415	204.400	5,603,626.00	
	INVESTOR AB-B SHS	101,275	190.740	19,317,193.50	
	KINNEVIK AB - B	12,465	191.950	2,392,656.75	
	LUNDBERGS AB-B SHS	3,368	450.800	1,518,294.40	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	5,323	491.400	2,615,722.20	
	SAGAX AB-B	9,651	247.300	2,386,692.30	
	SINCH AB	27,690	51.420	1,423,819.80	
	ERICSSON LM-B SHS	159,685	81.450	13,006,343.25	
	HEXAGON AB-B SHS	117,010	124.450	14,561,894.50	
	TELE2 AB-B SHS	25,537	149.250	3,811,397.25	
	TELIA CO AB	143,404	38.920	5,581,283.68	
	EMBRACER GROUP AB	30,012	68.820	2,065,425.84	
	スウェーデン・クローナ 小計	1,908,429		292,958,574.32  (3,852,405,252)	
ユーロ	ENI SPA	146,752	12.930	1,897,503.36	
	GALP ENERGIA SGPS SA	25,920	10.650	276,048.00	
	NESTE OYJ	23,055	42.630	982,834.65	
	OMV AG	8,389	44.020	369,283.78	
	REPSOL SA	79,358	12.605	1,000,307.59	
	TENARIS SA	25,963	13.590	352,837.17	
	TOTALENERGIES SE	142,236	44.030	6,262,651.08	
	AIR LIQUIDE SA	26,340	159.340	4,197,015.60	
	AKZO NOBEL N.V.	9,886	82.600	816,583.60	
	ARCELORMITTAL	37,054	26.920	997,493.68	
	ARKEMA	3,250	109.150	354,737.50	
	BASF SE	53,726	51.730	2,779,245.98	
	COVESTRO AG	11,797	41.110	484,974.67	
	CRH PLC	43,426	37.570	1,631,514.82	
	EVONIK INDUSTRIES AG	10,952	24.760	271,171.52	
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	3,370	30.820	103,863.40	

HEIDELBERGCEMENT AG	8,677	53.960	468,210.92	
KONINKLIJKE DSM NV	10,433	153.700	1,603,552.10	
LANXESS AG	4,409	36.840	162,427.56	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	12,921	39.120	505,469.52	
SOLVAY SA	4,802	88.620	425,553.24	
STORA ENSO OYJ-R SHS	30,234	17.455	527,734.47	
SYMRISE AG	6,785	109.250	741,261.25	
UMICORE	10,288	35.690	367,178.72	
UPM-KYMMENE OYJ	33,126	31.600	1,046,781.60	
VOESTALPINE AG	7,382	23.980	177,020.36	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	13,189	24.360	321,284.04	
AIRBUS SE	34,199	103.000	3,522,497.00	
ALSTOM	17,665	21.860	386,156.90	
BOUYGUES SA	11,049	32.570	359,865.93	
BRENNTAG SE	9,920	73.340	727,532.80	
CNH INDUSTRIAL NV	54,775	13.300	728,507.50	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	29,471	54.490	1,605,874.79	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	23,340	25.500	595,170.00	
DASSAULT AVIATION SA	1,720	157.300	270,556.00	
EIFFAGE	4,989	94.580	471,859.62	
FERROVIAL SA	24,693	24.310	600,286.83	
GEA GROUP AG	8,178	37.030	302,831.34	
IMCD NV	3,214	150.900	484,992.60	
KINGSPAN GROUP PLC	8,978	87.020	781,265.56	
KION GROUP AG	3,179	56.700	180,249.30	
KNORR-BREMSE AG	3,881	67.660	262,588.46	
KONE OYJ-B	20,623	45.400	936,284.20	
LEGRAND SA	15,079	83.860	1,264,524.94	
MTU AERO ENGINES AG	2,957	189.050	559,020.85	
PRYSMIAN SPA	17,186	30.270	520,220.22	
RATIONAL AG	350	606.000	212,100.00	
SAFRAN SA	20,172	104.060	2,099,098.32	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	31,211	139.020	4,338,953.22	
SIEMENS AG-REG	44,055	115.980	5,109,498.90	
SIEMENS ENERGY AG	19,855	18.765	372,579.07	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	11,482	15.570	178,774.74	
THALES SA	5,403	123.450	667,000.35	
VINCI SA	29,309	94.100	2,757,976.90	
WARTSILA OYJ ABP	26,753	8.206	219,535.11	
BUREAU VERITAS SA	17,817	26.740	476,426.58	
RANDSTAD NV	6,241	52.520	327,777.32	
TELEPERFORMANCE	3,420	341.000	1,166,220.00	

WOLTERS KLUWER	14,578	95.580	1,393,365.24	
ADP	1,346	141.350	190,257.10	
AENA SME SA	4,377	147.100	643,856.70	
ATLANTIA SPA	26,501	22.770	603,427.77	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	33,148	7.205	238,831.34	
DEUTSCHE POST AG-REG	54,453	41.220	2,244,552.66	
GETLINK SE	22,311	17.675	394,346.92	
INPOST SA	10,902	5.840	63,667.68	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	17,873	77.470	1,384,621.31	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE- PRF	2,564	69.350	177,813.40	
CONTINENTAL AG	5,578	65.300	364,243.40	
FAURECIA	6,090	22.910	139,521.90	
FERRARI NV	6,949	195.600	1,359,224.40	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	49,868	63.830	3,183,074.44	
MICHELIN (CGDE)	9,617	116.950	1,124,708.15	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PRF	7,765	79.260	615,453.90	
RENAULT SA	8,830	23.115	204,105.45	
STELLANTIS NV	118,658	12.800	1,518,822.40	
VALEO	14,444	17.260	249,303.44	
VOLKSWAGEN AG	1,960	209.900	411,404.00	
VOLKSWAGEN AG-PREF	10,563	149.020	1,574,098.26	
ADIDAS AG	11,195	192.240	2,152,126.80	
ESSILORLUXOTTICA	16,375	163.900	2,683,862.50	
HERMES INTERNATIONAL	1,777	1,179.000	2,095,083.00	
KERING	4,123	506.200	2,087,062.60	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	15,873	615.600	9,771,418.80	
MONCLER SPA	12,209	47.680	582,125.12	
PUMA SE	6,459	71.360	460,914.24	
SEB SA	1,127	120.600	135,916.20	
ACCOR SA	10,451	30.350	317,187.85	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	8,869	96.760	858,164.44	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,785	34.860	201,665.10	
SODEXO SA	4,760	72.340	344,338.40	
DELIVERY HERO SE	8,530	31.250	266,562.50	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	58,328	20.250	1,181,142.00	
JUST EAT TAKEAWAY	9,307	25.295	235,420.56	
PROSUS NV	54,174	42.675	2,311,875.45	
ZALANDO SE	12,367	39.500	488,496.50	

CARREFOUR SA	35,990	19.800	712,602.00	
COLRUYT SA	2,164	34.980	75,696.72	
HELLOFRESH SE	9,790	35.730	349,796.70	
JERONIMO MARTINS	12,978	20.300	263,453.40	
KESKO OYJ-B SHS	13,402	23.720	317,895.44	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	55,657	28.105	1,564,239.98	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	49,732	54.760	2,723,324.32	
DANONE	37,154	56.180	2,087,311.72	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	28,021	10.630	297,863.23	
HEINEKEN HOLDING NV	6,168	75.100	463,216.80	
HEINEKEN NV	14,659	94.480	1,384,982.32	
JDE PEET'S NV	6,660	27.440	182,750.40	
KERRY GROUP PLC-A	8,193	101.600	832,408.80	
PERNOD RICARD SA	11,879	192.350	2,284,925.65	
REMY COINTREAU	1,273	186.300	237,159.90	
BEIERSDORF AG	5,138	96.640	496,536.32	
HENKEL AG & CO KGAA	5,974	60.650	362,323.10	
HENKEL AG & CO KGAA VOR- PREF	11,499	61.580	708,108.42	
L'OREAL	14,230	341.900	4,865,237.00	
AMPLIFON SPA	7,567	38.140	288,605.38	
BIOMERIEUX	2,791	91.100	254,260.10	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,161	126.250	272,826.25	
DIASORIN SPA	1,313	124.000	162,812.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	11,118	60.400	671,527.20	
FRESENIUS SE & CO KGAA	26,317	33.660	885,830.22	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	52,727	24.975	1,316,856.82	
ORPEA	2,695	34.450	92,842.75	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,308	367.300	480,428.40	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	16,426	54.000	887,004.00	
ARGENX SE	2,644	293.400	775,749.60	
BAYER AG-REG	55,293	64.430	3,562,527.99	
EUROFINS SCIENTIFIC	7,010	91.120	638,751.20	
GRIFOLS SA	15,169	17.000	257,873.00	
IPSEN	1,498	109.800	164,480.40	
MERCK KGAA	7,777	171.650	1,334,922.05	
ORION OYJ-CLASS B	6,261	40.120	251,191.32	
QIAGEN N.V.	12,543	41.990	526,680.57	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	4,578	45.670	209,077.26	
SANOFI	65,399	100.900	6,598,759.10	

SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,555	310.100	482,205.50	
UCB SA	6,623	108.500	718,595.50	
ABN AMRO BANK NV-CVA	28,787	11.500	331,050.50	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	378,832	4.810	1,822,181.92	
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	187,906	0.010	1,879.06	
BANCO SANTANDER SA	983,269	3.054	3,002,903.52	
BNP PARIBAS	65,416	50.850	3,326,403.60	
CAIXABANK SA	277,723	3.023	839,556.62	
COMMERZBANK AG	46,644	6.338	295,629.67	
CREDIT AGRICOLE SA	73,102	10.432	762,600.06	
ERSTE GROUP BANK AG	19,383	30.930	599,516.19	
FINECOBANK SPA	32,034	13.410	429,575.94	
ING GROEP NV	230,297	9.373	2,158,573.78	
INTESA SANPAOLO	977,250	1.948	1,903,683.00	
KBC GROUP NV	13,092	64.440	843,648.48	
MEDIOBANCA SPA	31,303	9.230	288,926.69	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	7,066	10.610	74,970.26	
SOCIETE GENERALE SA	41,025	23.465	962,651.62	
UNICREDIT SPA	112,845	9.139	1,031,290.45	
AMUNDI SA	3,955	58.550	231,565.25	
DEUTSCHE BANK AG- REGISTERED	113,478	10.392	1,179,263.37	
DEUTSCHE BOERSE AG	10,701	163.950	1,754,428.95	
EURAZEO SE	1,792	75.500	135,296.00	
EURONEXT NV	5,502	77.720	427,615.44	
EXOR NV	6,204	66.900	415,047.60	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,914	90.480	535,098.72	
SOFINA	804	301.000	242,004.00	
WENDEL	1,082	93.550	101,221.10	
AEGON NV	91,609	5.012	459,144.30	
AGEAS	11,247	46.570	523,772.79	
ALLIANZ SE-REG	23,552	212.650	5,008,332.80	
ASSICURAZIONI GENERALI	64,729	18.120	1,172,889.48	
AXA SA	113,586	25.775	2,927,679.15	
CNP ASSURANCES	8,978	21.800	195,720.40	
HANNOVER RUECK SE	3,598	145.000	521,710.00	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	8,295	228.000	1,891,260.00	
NN GROUP NV	14,069	46.030	647,596.07	
POSTE ITALIANE SPA	26,562	9.428	250,426.53	
SAMPO OYJ-A SHS	28,454	46.400	1,320,265.60	
AROUNDTOWN SA	52,560	4.893	257,176.08	

LEG IMMOBILIEN SE	3,680	98.200	361,376.00	
VONOVIA SE	43,654	39.360	1,718,221.44	
ADYEN NV	1,069	1,609.600	1,720,662.40	
AMADEUS IT GROUP SA	24,570	59.660	1,465,846.20	
BECHTLE AG	4,305	43.620	187,784.10	
CAPGEMINI SE	8,961	188.000	1,684,668.00	
DASSAULT SYSTEMES SE	39,595	39.875	1,578,850.62	
EDENRED	16,042	48.610	779,801.62	
NEMETSCHEK SE	3,011	76.600	230,642.60	
NEXI SPA	30,853	8.972	276,813.11	
SAP SE	60,055	95.740	5,749,665.70	
WORLDLINE SA	12,774	35.180	449,389.32	
NOKIA OYJ	296,676	4.815	1,428,494.94	
ASM INTERNATIONAL NV	2,455	303.800	745,829.00	
ASML HOLDING NV	23,576	547.700	12,912,575.20	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	71,533	27.885	1,994,697.70	
STMICROELECTRONICS NV	37,804	35.275	1,333,536.10	
CELLNEX TELECOM SA	29,081	45.480	1,322,603.88	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	188,344	17.152	3,230,476.28	
ELISA OYJ	8,681	55.020	477,628.62	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,804	10.130	160,094.52	
KONINKLIJKE KPN NV	173,603	3.262	566,292.98	
ORANGE	116,269	11.136	1,294,771.58	
PROXIMUS	10,895	16.965	184,833.67	
TELECOM ITALIA SPA	696,355	0.280	194,979.40	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	46,895	2.837	133,041.11	
TELEFONICA SA	316,236	4.798	1,517,300.32	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,269	30.790	162,232.51	
E.ON SE	126,998	10.260	1,302,999.48	
EDF	32,658	9.032	294,967.05	
EDP RENOVAVEIS SA	14,791	23.000	340,193.00	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	170,355	4.684	797,942.82	
ELIA GROUP SA/NV	2,106	149.000	313,794.00	
ENAGAS SA	14,471	20.520	296,944.92	
ENDESA SA	14,104	20.020	282,362.08	
ENEL SPA	475,178	6.103	2,900,011.33	
ENGIE	110,679	11.560	1,279,449.24	
FORTUM OYJ	24,312	16.080	390,936.96	
IBERDROLA SA	337,074	10.585	3,567,928.29	
NATURGY ENERGY GROUP SA	12,930	29.040	375,487.20	

RED ELECTRICA CORPORACION SA	23,632	18.705	442,036.56	
RWE AG	34,673	40.080	1,389,693.84	
SNAM SPA	106,707	5.204	555,303.22	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONALE	75,662	7.772	588,045.06	
UNIPER SE	4,697	24.120	113,291.64	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	36,122	28.660	1,035,256.52	
VERBUND AG	3,190	98.650	314,693.50	
BOLLORE SE	39,433	4.550	179,420.15	
PUBLICIS GROUPE	13,301	56.960	757,624.96	
SCOUT24 SE	4,671	58.940	275,308.74	
UBISOFT ENTERTAINMENT	4,745	42.080	199,669.60	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	44,422	23.435	1,041,029.57	
VIVENDI SE	38,496	11.535	444,051.36	
ユーロ小計	10,772,399		249,120,571.28 (34,099,623,797)	
合計	61,248,461		367,861,655.320 (367,861,655,320)	

(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	70.5%	73.5%
カナダ・ドル	株式	86銘柄	3.7%	3.9%
オーストラリア・ドル	株式	50銘柄	2.1%	2.2%
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%	4.5%
イスラエル・シケル	株式	8銘柄	0.1%	0.1%
スイス・フラン	株式	41銘柄	3.0%	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%	1.0%
ユーロ	株式	228銘柄	8.9%	9.3%

(b)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	25,432.00	296,791.44	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8,490.00	1,638,570.00	
		AMERICAN TOWER CORP	26,197.00	6,798,645.44	



	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	90,010.00	587,765.30	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	8,302.00	2,062,382.84	
	BOSTON PROPERTIES INC	7,835.00	985,799.70	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	6,009.00	986,677.80	
	CROWN CASTLE INTL CORP	25,016.00	4,824,835.92	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	16,754.00	2,539,236.24	
	DUKE REALTY CORP	21,667.00	1,285,503.11	
	EQUINIX INC	5,232.00	3,937,184.64	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,664.00	708,022.08	
	EQUITY RESIDENTIAL	21,246.00	1,918,088.88	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,691.00	1,284,800.19	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	7,376.00	1,538,191.04	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	28,756.00	985,755.68	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	37,569.00	786,319.17	
	INVITATION HOMES INC	32,632.00	1,396,975.92	
	IRON MOUNTAIN INC	15,785.00	879,540.20	
	KIMCO REALTY CORP	35,169.00	901,029.78	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	31,858.00	590,647.32	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	6,678.00	1,369,123.56	
	PROLOGIS INC	42,504.00	7,129,195.92	
	PUBLIC STORAGE	8,778.00	3,502,422.00	
	REALTY INCOME CORP	31,385.00	2,283,258.75	
	REGENCY CENTERS CORP	8,289.00	581,887.80	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	5,916.00	2,129,405.04	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	18,517.00	2,338,511.93	
	SUN COMMUNITIES INC	6,088.00	1,150,632.00	
	UDR INC	16,633.00	961,387.40	
	VENTAS INC	23,363.00	1,360,193.86	
	VICI PROPERTIES INC	36,025.00	1,081,830.75	
	VORNADO REALTY TRUST	8,706.00	360,515.46	
	WELLTOWER INC	24,682.00	2,358,611.92	
	WEYERHAEUSER CO	44,952.00	1,870,902.24	
	WP CAREY INC	11,067.00	937,042.89	
	アメリカ・ドル小計	757,273.00	66,347,684.21 (8,465,964,505)	
カナ ダ・ド ル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,971.00	204,744.76	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,441.00	182,750.96	
	カナダ・ドル小計	11,412.00	387,495.72 (38,830,946)	
	APA GROUP	68,281.00	781,134.64	

オーストラリア・ドル	DEXUS/AU	72,475.00	789,977.50	
	GOODMAN GROUP	95,350.00	2,252,167.00	
	GPT GROUP	121,221.00	615,802.68	
	LENLEASE GROUP	36,263.00	426,452.88	
	MIRVAC GROUP	200,053.00	480,127.20	
	SCENTRE GROUP	275,200.00	806,336.00	
	STOCKLAND	127,393.00	528,680.95	
	TRANSURBAN GROUP	176,197.00	2,464,996.03	
	VICINITY CENTRES	241,241.00	451,120.67	
オーストラリア・ドル小計		1,413,674.00	9,596,795.55 (880,697,928)	
香港・ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS - SS	193,500.00	1,488,015.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	197,000.00	2,163,060.00	
	LINK REIT	110,100.00	7,486,800.00	
香港・ドル小計		500,600.00	11,137,875.00 (181,101,848)	
シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	170,500.00	487,630.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	259,616.00	602,309.12	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	112,400.00	214,684.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	208,100.00	374,580.00	
シンガポール・ドル小計		750,616.00	1,679,203.12 (156,098,722)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	62,406.00	316,273.60	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	39,861.00	300,392.49	
	SEGRO PLC	68,623.00	934,988.37	
イギリス・ポンド小計		170,890.00	1,551,654.46 (252,361,080)	
ユーロ	COVIVIO	2,388.00	164,294.40	
	GECINA SA	2,189.00	240,352.20	
	KLEPIERRE	13,600.00	311,984.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	7,024.00	492,874.08	
ユーロ小計		25,201.00	1,209,504.68 (165,557,001)	
投資証券合計			10,140,612,029 (10,140,612,029)	
合 計			10,140,612,029 (10,140,612,029)	

(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	2.2%	83.5%
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%	8.7%
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%	1.6%

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

## エマージング株式インデックス・マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2021年4月26日現在)	(2022年4月26日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
預金	251,077,719	1,420,250,939
金銭信託	762,512,013	35,129,306
コール・ローン	1,749,778,290	1,771,896,597
株式	9,586,932,925	13,549,402,847
投資信託受益証券	497,674,247	752,699,820
投資証券	912,831,155	1,401,586,708
派生商品評価勘定	16,583,310	245,941,843
未収入金	16,081,391	121,741
未収配当金	12,315,820	31,232,619
差入委託証拠金	785,870,472	844,604,732
<b>流動資産合計</b>	<b>14,591,657,342</b>	<b>20,052,867,152</b>
<b>資産合計</b>	<b>14,591,657,342</b>	<b>20,052,867,152</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
派生商品評価勘定	33,807,564	62,722,219
前受金	121,915	-
未払解約金	290,000	22,441,148
未払利息	5,064	-
その他未払費用	64,023	4,032
<b>流動負債合計</b>	<b>34,288,566</b>	<b>85,167,399</b>
<b>負債合計</b>	<b>34,288,566</b>	<b>85,167,399</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	8,325,755,557	12,191,357,761
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	6,231,613,219	7,776,341,992
<b>元本等合計</b>	<b>14,557,368,776</b>	<b>19,967,699,753</b>
<b>純資産合計</b>	<b>14,557,368,776</b>	<b>19,967,699,753</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>14,591,657,342</b>	<b>20,052,867,152</b>

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年4月27日 至 2022年4月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、新株予約権証券、投資信託受益証券、投資証券は移動平均法に基づき、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年4月26日現在)	(2022年4月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	8,325,755,557口	12,191,357,761口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.7485円 (1万口当たりの純資産額17,485円)	1口当たり純資産額 1.6379円 (1万口当たりの純資産額16,379円)

## （金融商品に関する注記）

## ．金融商品の状況に関する事項

項 目	自 2021年4月27日 至 2022年4月26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券、社債券、投資信託受益証券、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年4月26日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券（株式、投資信託受益証券、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MSCIE 2106	3,557,460,207	-	3,557,582,122	121,915
	小計	3,557,460,207	-	3,557,582,122	121,915
合 計		3,557,460,207	-	3,557,582,122	121,915

(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	2,684,900,000	-	2,664,838,702	20,061,298
	小計	2,684,900,000	-	2,664,838,702	20,061,298
	売建				
	アメリカ・ドル	157,000,000	-	154,284,871	2,715,129
	小計	157,000,000	-	154,284,871	2,715,129
合 計		2,841,900,000	-	2,819,123,573	17,346,169

(2022年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MSCI EMGMKT JUN22	4,275,648,872	-	4,259,752,464	15,896,408
	小計	4,275,648,872	-	4,259,752,464	15,896,408
合 計		4,275,648,872	-	4,259,752,464	15,896,408

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1)原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引 以外の取 引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	2,737,900,000	-	2,974,595,381	236,695,381
	小計	2,737,900,000	-	2,974,595,381	236,695,381
	売建				
	アメリカ・ドル	952,000,000	-	989,579,349	37,579,349
	小計	952,000,000	-	989,579,349	37,579,349
合 計		3,689,900,000	-	3,964,174,730	199,116,032

## (注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

自 2021年4月27日 至 2022年4月26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26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	5,713,549,870円
同期中における追加設定元本額	4,826,668,980円
同期中における一部解約元本額	2,214,463,293円
2021年4月26日現在の元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	4,212,467,456円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	2,168,457,848円



アセットアロケーション・ファンド(安定型)	423,316,544円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	466,719,046円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	305,570,265円
イオン・バランス戦略ファンド	36,830,971円
三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2050	19,428,099円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	51,180,927円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	38,730,510円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	184,820,124円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	125,451,007円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	215,280,733円
三井住友・D CつみたてN I S A・世界分散ファンド	45,405,336円
三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2060	2,767,956円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	29,328,735円
合計	8,325,755,557円

(2022年4月26日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	8,325,755,557円
同期中における追加設定元本額	6,016,733,591円
同期中における一部解約元本額	2,151,131,387円
2022年4月26日現在の元本の内訳	
三井住友・D CつみたてN I S A・全海外株インデックスファンド	6,746,739,785円
三井住友・D C新興国株式インデックスファンド	2,714,636,324円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	44,385,580円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	237,701,767円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	157,541,199円
三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2050	28,182,083円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	90,118,390円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	65,071,224円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	259,245,317円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	214,464,764円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	348,547,103円
三井住友・D CつみたてN I S A・世界分散ファンド	78,602,899円
三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2060	3,563,961円
日興F W S・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	430,155,490円
日興F W S・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	711,584,443円
三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド	5,814,304円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	55,003,128円
合計	12,191,357,761円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

			評価額
--	--	--	-----

通貨	銘柄	株数	単価	金額	備考
アメリカ・ドル	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	4,068	8.890	36,164.52	
	SOUTHERN COPPER CORP	1,560	64.290	100,292.40	
	51JOB INC-ADR	507	60.820	30,835.74	
	DIDI GLOBAL INC	4,435	1.800	7,983.00	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	8,212	23.750	195,035.00	
	LI AUTO INC - ADR	10,440	22.310	232,916.40	
	NIO INC - ADR	24,428	17.310	422,848.68	
	XPENG INC - ADR	7,360	24.210	178,185.60	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	3,165	30.020	95,013.30	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	2,577	10.400	26,800.80	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	7,046	2.810	19,799.26	
	TRIP.COM GROUP LTD-ADR	9,500	21.620	205,390.00	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	7,985	40.970	327,145.45	
	DADA NEXUS LTD-ADR	799	7.690	6,144.31	
	PINDUODUO INC-ADR	8,046	35.600	286,437.60	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	7,497	6.980	52,329.06	
	RLX TECHNOLOGY INC-ADR	10,343	1.860	19,237.98	
	BEIGENE LTD-ADR	893	162.800	145,380.40	
	HUTCHMED CHINA-ADR	1,444	15.930	23,002.92	
	I-MAB-SPONSORED ADR	643	12.660	8,140.38	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	724	39.080	28,293.92	
	ZAI LAB LTD-ADR	1,359	45.890	62,364.51	
	CREDICORP LTD	1,240	139.840	173,401.60	
	360 DIGITECH INC	1,578	13.800	21,776.40	
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	12,160	5.220	63,475.20	
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	571	17.970	10,260.87	
	KE HOLDINGS INC-ADR	6,927	12.340	85,479.18	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	21,280	0.901	19,173.28	
	CHINDATA GROUP HOLDINGS- ADR	1,520	4.850	7,372.00	
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	1,490	27.820	41,451.80	
	KINGSOFT CLOUD HOLDINGS- ADR	1,994	3.410	6,799.54	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	7,100	3.597	25,538.70	
DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	982	40.770	40,036.14		
AUTOHOME INC-ADR	1,276	25.920	33,073.92		
BAIDU INC - SPON ADR	5,110	116.570	595,672.70		

	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	3,066	21.250	65,152.50	
	HELLO GROUP INC -SPN ADR	2,159	4.440	9,585.96	
	IQIYI INC-ADR	4,740	3.200	15,168.00	
	JOYY INC-ADR	933	37.690	35,164.77	
	KANZHUN LTD - ADR	1,553	19.810	30,764.93	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM- ADR	11,158	4.120	45,970.96	
	WEIBO CORP-SPON ADR	1,053	21.150	22,270.95	
	アメリカ・ドル小計	210,921		3,857,330.63 (492,195,387)	
香港・ド ル	CHINA COAL ENERGY CO-H	34,000	6.120	208,080.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	26,000	7.300	189,800.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	444,000	3.860	1,713,840.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	64,500	23.850	1,538,325.00	
	CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	29,000	4.230	122,670.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	400,000	3.740	1,496,000.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO- H	30,000	21.000	630,000.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	72,000	3.630	261,360.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	22,500	38.500	866,250.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	47,000	10.100	474,700.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	66,000	3.930	259,380.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	74,000	9.420	697,080.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	38,000	6.140	233,320.00	
	DONGYUE GROUP	24,000	8.190	196,560.00	
	GANFENG LITHIUM CO LTD-H	4,400	79.100	348,040.00	
	HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	18,000	4.080	73,440.00	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	20,000	12.180	243,600.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	13,000	3.630	47,190.00	
	MMG LTD	32,000	3.040	97,280.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	37,000	6.550	242,350.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	14,250	14.440	205,770.00		
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	100,000	11.360	1,136,000.00		

AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	51,000	3.860	196,860.00	
BOC AVIATION LTD	3,500	58.600	205,100.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	54,000	3.300	178,200.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	29,000	20.900	606,100.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	15,000	8.200	123,000.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	80,000	4.800	384,000.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	34,000	8.980	305,320.00	
CITIC LTD	113,000	8.110	916,430.00	
CRRC CORP LTD - H	85,000	2.790	237,150.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	47,500	7.840	372,400.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	13,000	18.260	237,380.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	19,000	7.270	138,130.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	10,000	8.540	85,400.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	32,000	10.280	328,960.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	10,418	10.940	113,972.92	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	9,100	24.000	218,400.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	13,000	4.650	60,450.00	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	77,000	4.400	338,800.00	
AIR CHINA LTD-H	32,000	5.220	167,040.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	44,000	4.190	184,360.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	24,140	13.240	319,613.60	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	24,000	4.230	101,520.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	65,400	11.620	759,948.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	24,000	5.400	129,600.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	22,000	7.630	167,860.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	27,000	8.200	221,400.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	32,000	6.610	211,520.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	30,000	4.430	132,900.00	
BYD CO LTD-H	15,500	219.400	3,400,700.00	

DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	46,000	5.360	246,560.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	12,400	29.350	363,940.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	110,000	10.800	1,188,000.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	60,000	10.180	610,800.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	55,200	6.190	341,688.00	
MINTH GROUP LTD	14,000	17.180	240,520.00	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	24,000	11.100	266,400.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	19,800	85.000	1,683,000.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	72,000	3.810	274,320.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	43,400	25.350	1,100,190.00	
LI NING CO LTD	44,000	57.500	2,530,000.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	15,600	105.900	1,652,040.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	12,000	5.900	70,800.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	21,000	12.920	271,320.00	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	16,000	14.300	228,800.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	15,200	13.000	197,600.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	279,000	81.850	22,836,150.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	68,000	3.880	263,840.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	12,000	24.550	294,600.00	
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	36,000	1.850	66,600.00	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	198,000	0.385	76,230.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	6,600	43.450	286,770.00	
JD.COM INC - CL A	36,885	200.800	7,406,508.00	
MEITUAN-CLASS B	75,100	138.600	10,408,860.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	6,100	18.640	113,704.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	21,000	5.830	122,430.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	10,500	50.900	534,450.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	24,500	2.280	55,860.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	2,000	100.390	200,780.00	

CHINA FEIHE LTD	60,000	6.990	419,400.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	58,000	41.950	2,433,100.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	26,000	42.300	1,099,800.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	51,000	3.900	198,900.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	32,400	41.000	1,328,400.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	35,000	15.920	557,200.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	40,000	14.300	572,000.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	10,000	58.400	584,000.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	28,000	6.580	184,240.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	88,000	6.700	589,600.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	9,000	22.050	198,450.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	11,000	37.350	410,850.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	4,000	17.540	70,160.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	5,600	33.450	187,320.00	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	20,000	5.220	104,400.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	9,000	14.120	127,080.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	50,400	7.860	396,144.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS- H	16,600	12.320	204,512.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	25,200	16.880	425,376.00	
VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H	3,000	12.240	36,720.00	
3SBIO INC	17,000	5.290	89,930.00	
AKESO INC	4,000	12.780	51,120.00	
CANSINO BIOLOGICS INC-H	1,000	90.000	90,000.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	27,000	10.620	286,740.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	42,000	3.750	157,500.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	170,800	8.020	1,369,816.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	20,000	20.550	411,000.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	2,500	78.300	195,750.00	

HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	18,000	12.560	226,080.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	23,000	23.500	540,500.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	2,000	92.200	184,400.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	7,500	32.250	241,875.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	200,000	3.940	788,000.00	
WUXI APTEC CO LTD-H	6,911	102.800	710,450.80	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	66,500	53.650	3,567,725.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	479,000	2.930	1,403,470.00	
BANK OF CHINA LTD-H	1,457,000	3.090	4,502,130.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	161,000	5.470	880,670.00	
CHINA BOHAI BANK CO LTD-H	27,500	1.330	36,575.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	149,000	3.940	587,060.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,764,000	5.550	9,790,200.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	77,000	2.850	219,450.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	71,500	46.700	3,339,050.00	
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	106,600	2.920	311,272.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	1,047,000	4.670	4,889,490.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	142,000	6.240	886,080.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	188,000	1.300	244,400.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	58,500	4.210	246,285.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	24,000	15.160	363,840.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	48,000	16.300	782,400.00	
FAR EAST HORIZON LTD	28,000	6.600	184,800.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	17,000	9.540	162,180.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	42,800	5.480	234,544.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	24,600	10.620	261,252.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	136,000	11.440	1,555,840.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	48,400	17.600	851,840.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	35,400	8.810	311,874.00	

NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	17,100	19.500	333,450.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	127,000	2.450	311,150.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY- H	126,000	7.840	987,840.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	117,000	50.600	5,920,200.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	6,700	22.800	152,760.00	
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	12,000	3.580	42,960.00	
A-LIVING SMART CITY SERVICES	7,000	11.620	81,340.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	66,000	1.650	108,900.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	96,000	2.410	231,360.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	72,500	24.200	1,754,500.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	30,000	8.820	264,600.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	60,000	34.700	2,082,000.00	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	11,800	35.700	421,260.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	28,600	18.200	520,520.00	
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES	10,000	9.570	95,700.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	58,000	3.610	209,380.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	139,000	5.200	722,800.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	38,000	30.000	1,140,000.00	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	12,500	12.960	162,000.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	34,000	7.330	249,220.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	26,800	2.800	75,040.00	
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	11,000	14.340	157,740.00	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	12,500	2.570	32,125.00	
LOGAN GROUP CO LTD	16,000	2.210	35,360.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	34,500	38.900	1,342,050.00	
POWERLONG REAL ESTATE HOLDIN	25,000	2.380	59,500.00	



SEAZEN GROUP LTD	32,000	3.280	104,960.00	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	18,500	4.420	81,770.00	
SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD	10,000	3.850	38,500.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	53,000	4.580	242,740.00	
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	18,000	3.790	68,220.00	
WHARF HOLDINGS LTD	23,000	22.050	507,150.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	17,600	8.260	145,376.00	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	44,000	5.880	258,720.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	50,000	13.760	688,000.00	
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	12,000	8.810	105,720.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	21,000	11.000	231,000.00	
WEIMOB INC	38,000	4.040	153,520.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	13,500	15.720	212,220.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	13,000	13.640	177,320.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	13,500	34.500	465,750.00	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	21,000	11.780	247,380.00	
LENOVO GROUP LTD	132,000	7.450	983,400.00	
SUNNY OPTICAL TECH	13,100	103.100	1,350,610.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	261,400	10.920	2,854,488.00	
ZTE CORP-H	16,600	15.480	256,968.00	
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	9,000	23.850	214,650.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	9,000	27.200	244,800.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	94,000	10.920	1,026,480.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	702,000	0.870	610,740.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	10,500	25.700	269,850.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	100,000	2.480	248,000.00	
CGN POWER CO LTD-H	167,000	2.080	347,360.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	54,000	8.700	469,800.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	59,000	15.120	892,080.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	112,000	3.690	413,280.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	16,000	29.300	468,800.00	

	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	34,000	14.000	476,000.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	15,000	100.900	1,513,500.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	54,000	9.930	536,220.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	76,000	3.710	281,960.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	78,000	6.260	488,280.00	
	ALIBABA PICTURES GROUP LTD	260,000	0.600	156,000.00	
	CHINA LITERATURE LTD	6,800	28.200	191,760.00	
	KINGSOFT CORP LTD	16,000	21.100	337,600.00	
	KUAISHOU TECHNOLOGY	9,400	55.300	519,820.00	
	NETEASE INC	38,000	133.400	5,069,200.00	
	TENCENT HOLDINGS LTD	105,800	327.400	34,638,920.00	
	香港・ドル小計	15,365,904		203,222,217.32 (3,304,393,254)	
台湾・ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	19,000	90.100	1,711,900.00	
	ASIA CEMENT CORP	37,000	46.900	1,735,300.00	
	CHINA STEEL CORP	216,000	36.600	7,905,600.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	61,000	80.200	4,892,200.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	70,000	106.000	7,420,000.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	97,000	85.900	8,332,300.00	
	TAIWAN CEMENT	91,077	46.100	4,198,649.70	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	3,000	805.000	2,415,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	49,000	30.000	1,470,000.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	4,214	219.000	922,866.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	1,000	1,290.000	1,290,000.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	47,740	139.500	6,659,730.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	29,000	28.200	817,800.00	
	WAN HAI LINES LTD	12,700	148.000	1,879,600.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	34,000	121.500	4,131,000.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	30,000	33.800	1,014,000.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	4,000	475.000	1,900,000.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	7,640	190.000	1,451,600.00	
	GIANT MANUFACTURING	5,000	248.500	1,242,500.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	3,000	312.500	937,500.00	
	POU CHEN	39,000	31.300	1,220,700.00	

HOTAI MOTOR COMPANY LTD	6,000	573.000	3,438,000.00	
MOMO.COM INC	1,000	912.000	912,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	10,000	272.000	2,720,000.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	89,000	67.600	6,016,400.00	
ONENESS BIOTECH CO LTD	5,000	199.000	995,000.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	65,754	18.500	1,216,449.00	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	340,000	29.100	9,894,000.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	227,201	32.450	7,372,672.45	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	197,792	27.600	5,459,059.20	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	165,855	23.150	3,839,543.25	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	200,000	41.550	8,310,000.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	197,760	18.250	3,609,120.00	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	197,958	19.150	3,790,895.70	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	182,105	28.300	5,153,571.50	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	60,299	48.550	2,927,516.45	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	24,463	236.500	5,785,499.50	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	186,160	26.250	4,886,700.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	145,000	63.800	9,251,000.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	292,196	18.150	5,303,357.40	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	141,000	74.800	10,546,800.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	199,432	10.000	1,994,320.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	19,180	67.800	1,300,404.00	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	10,000	211.000	2,110,000.00	
ACER INC	48,000	27.100	1,300,800.00	
ADVANTECH CO LTD	7,299	374.000	2,729,826.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	13,000	356.000	4,628,000.00	
AU OPTRONICS CORP	137,000	17.700	2,424,900.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	11,000	145.500	1,600,500.00	
COMPAL ELECTRONICS	70,000	22.200	1,554,000.00	

DELTA ELECTRONICS INC	36,000	236.500	8,514,000.00	
E INK HOLDINGS INC	17,000	169.500	2,881,500.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	15,000	59.500	892,500.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	230,800	100.500	23,195,400.00	
INNOLUX CORP	158,000	14.650	2,314,700.00	
INVENTEC CORP	42,000	24.800	1,041,600.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	2,080	1,685.000	3,504,800.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	35,000	68.000	2,380,000.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	11,000	119.000	1,309,000.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	4,000	406.500	1,626,000.00	
PEGATRON CORP	33,000	70.500	2,326,500.00	
QUANTA COMPUTER INC	52,000	83.200	4,326,400.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	22,000	76.900	1,691,800.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	23,000	202.000	4,646,000.00	
WIWYNN CORP	2,000	967.000	1,934,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	24,520	54.700	1,341,244.00	
YAGEO CORPORATION	8,198	393.500	3,225,913.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	11,000	104.500	1,149,500.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	63,000	94.600	5,959,800.00	
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	500	1,450.000	725,000.00	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	1,000	1,125.000	1,125,000.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	4,000	549.000	2,196,000.00	
MEDIATEK INC	28,000	837.000	23,436,000.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	21,000	64.300	1,350,300.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	10,000	374.500	3,745,000.00	
PARADE TECHNOLOGIES LTD	1,000	1,320.000	1,320,000.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	8,000	392.000	3,136,000.00	
SILERGY CORP	1,300	2,795.000	3,633,500.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	452,000	547.000	247,244,000.00	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	218,000	45.500	9,919,000.00	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	15,000	103.000	1,545,000.00	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	6,000	221.500	1,329,000.00	
WINBOND ELECTRONICS CORP	61,000	27.000	1,647,000.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	71,000	131.500	9,336,500.00	

	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	27,000	78.300	2,114,100.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	33,000	107.500	3,547,500.00	
	台湾・ドル小計	5,857,223		576,228,137.15 (2,505,382,318)	
エジプト・ポンド	EASTERN CO SAE	13,558	11.010	149,273.58	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BAN	29,470	42.000	1,237,740.00	
	FAWRY FOR BANKING & PAYMENT	5,390	4.880	26,303.20	
	FAWRY FOR BANKING & - RIGHTTS	5,051	4.060	20,507.06	
	エジプト・ポンド小計	53,469		1,433,823.84 (9,854,241)	
トルコ・リラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	2,650	259.400	687,410.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	25,680	34.500	885,960.00	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	8,452	27.000	228,204.00	
	KOC HOLDING AS	15,538	40.200	624,627.60	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	22,434	17.930	402,241.62	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	947	304.900	288,740.30	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	8,767	86.800	760,975.60	
	AKBANK T.A.S.	70,766	9.360	662,369.76	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	35,453	14.970	530,731.41	
	TURKIYE IS BANKASI-C	22,389	10.710	239,786.19	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	27,080	23.020	623,381.60	
	トルコ・リラ小計	240,156		5,934,428.08 (51,255,654)	
メキシコ・ペソ	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	58,500	97.870	5,725,395.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	3,095	237.970	736,517.15	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	20,300	48.140	977,242.00	
	ALFA S.A.B. -A	49,200	14.220	699,624.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	7,700	71.390	549,703.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	6,100	290.110	1,769,671.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	3,470	409.910	1,422,387.70	

	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	5,105	152.680	779,431.40	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	98,000	76.650	7,511,700.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	7,000	127.470	892,290.00	
	BEACLE SAB DE CV	12,700	47.750	606,425.00	
	GRUMA S.A.B.-B	3,575	243.040	868,868.00	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	26,200	56.140	1,470,868.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	25,400	29.110	739,394.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	48,700	141.220	6,877,414.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	45,000	36.700	1,651,500.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	570,600	21.390	12,205,134.00	
	メキシコ・ペソ小計	990,645		45,483,564.25 (287,033,129)	
フィリピン・ペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	42,090	56.900	2,394,921.00	
	AYALA CORPORATION	4,660	779.000	3,630,140.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	1,310	514.000	673,340.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	56,042	58.000	3,250,436.00	
	SM INVESTMENTS CORP	4,025	885.000	3,562,125.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	18,730	226.200	4,236,726.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	7,480	217.600	1,627,648.00	
	MONDE NISSIN CORP	75,000	12.740	955,500.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	17,230	109.800	1,891,854.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	33,757	98.200	3,314,937.40	
	BDO UNIBANK INC	35,590	133.000	4,733,470.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	38,980	55.500	2,163,390.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	110,900	3.830	424,747.00	
	AYALA LAND INC	158,000	34.750	5,490,500.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	177,300	36.150	6,409,395.00	
	GLOBE TELECOM INC	620	2,438.000	1,511,560.00	
	PLDT INC	1,255	1,910.000	2,397,050.00	
	AC ENERGY CORP	127,700	8.160	1,042,032.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	5,120	342.400	1,753,088.00	
	フィリピン・ペソ小計	915,789		51,462,859.40 (125,265,746)	
	EMPRESAS COPEC SA	8,012	6,281.000	50,323,372.00	

チリ・ペ ソ	EMPRESAS CMPC SA	22,543	1,325.000	29,869,475.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	2,369	62,606.000	148,313,614.00	
	FALABELLA SA	15,911	2,350.000	37,390,850.00	
	CENCOSUD SA	28,071	1,455.100	40,846,112.10	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	1,586	5,600.000	8,881,600.00	
	BANCO DE CHILE	824,852	88.210	72,760,194.92	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	1,001	26,562.000	26,588,562.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	1,209,844	41.180	49,821,375.92	
	ENEL AMERICAS SA	408,318	90.990	37,152,854.82	
	ENEL CHILE SA	364,877	23.420	8,545,419.34	
チリ・ペソ小計		2,887,384		510,493,430.10 (77,082,466)	
コロンビ ア・ペソ	ECOPETROL SA	92,687	3,280.000	304,013,360.00	
	BANCOLOMBIA SA	3,656	41,000.000	149,896,000.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	8,412	38,500.000	323,862,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	2,986	35,500.000	106,003,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	8,110	22,320.000	181,015,200.00	
コロンビア・ペソ小計		115,851		1,064,789,560.00 (34,541,773)	
インド・ ルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	14,493	369.700	5,358,062.10	
	COAL INDIA LTD	25,735	188.450	4,849,760.75	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	10,662	291.650	3,109,572.30	
	INDIAN OIL CORP LTD	29,088	127.750	3,715,992.00	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	49,390	169.650	8,379,013.50	
	PETRONET LNG LTD	12,527	202.850	2,541,101.95	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	52,588	2,695.000	141,724,660.00	
	ACC LTD	1,628	2,262.050	3,682,617.40	
	AMBUJA CEMENTS LTD	11,609	376.350	4,369,047.15	
	ASIAN PAINTS LTD	7,202	3,130.600	22,546,581.20	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	4,056	715.750	2,903,082.00	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	5,159	1,693.700	8,737,798.30	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	29,822	495.500	14,776,801.00	
	JSW STEEL LTD	16,324	715.700	11,683,086.80	
	PI INDUSTRIES LTD	1,393	2,855.850	3,978,199.05	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	2,546	2,408.350	6,131,659.10	
	SHREE CEMENT LTD	181	25,649.600	4,642,577.60	
	SRF LTD	2,473	2,434.750	6,021,136.75	
	TATA STEEL LTD	13,699	1,220.350	16,717,574.65	
	ULTRATECH CEMENT LTD	1,932	6,595.050	12,741,636.60	
UPL LTD	8,296	803.050	6,662,102.80		
VEDANTA LTD	21,814	402.100	8,771,409.40		

ADANI ENTERPRISES LTD	5,362	2,284.200	12,247,880.40	
BHARAT ELECTRONICS LTD	24,926	245.800	6,126,810.80	
HAVELLS INDIA LTD	4,184	1,301.900	5,447,149.60	
LARSEN & TOUBRO LTD	12,918	1,657.350	21,409,647.30	
SIEMENS LTD	1,167	2,261.700	2,639,403.90	
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	4,007	745.600	2,987,619.20	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	8,526	859.550	7,328,523.30	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	3,801	644.700	2,450,504.70	
INTERGLOBE AVIATION LTD	2,035	1,864.900	3,795,071.50	
BAJAJ AUTO LTD	1,160	3,682.950	4,272,222.00	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	1,453	2,030.200	2,949,880.60	
BHARAT FORGE LTD	3,465	701.550	2,430,870.75	
EICHER MOTORS LTD	2,283	2,594.150	5,922,444.45	
HERO MOTOCORP LTD	2,002	2,288.600	4,581,777.20	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	16,602	904.000	15,008,208.00	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,555	7,912.350	20,216,054.25	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	21,100	133.000	2,806,300.00	
MRF LTD	32	69,115.900	2,211,708.80	
TATA MOTORS LTD	31,578	425.150	13,425,386.70	
PAGE INDUSTRIES LTD	115	44,866.350	5,159,630.25	
TITAN CO LTD	6,723	2,453.900	16,497,569.70	
JUBILANT FOODWORKS LTD	6,600	540.600	3,567,960.00	
TRENT LTD	3,028	1,237.450	3,746,998.60	
ZOMATO LTD	26,199	78.750	2,063,171.25	
AVENUE SUPERMARTS LTD	3,094	3,989.200	12,342,584.80	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	1,811	3,295.900	5,968,874.90	
ITC LTD	56,661	255.250	14,462,720.25	
MARICO LTD	8,623	515.550	4,445,587.65	
NESTLE INDIA LTD	648	18,174.700	11,777,205.60	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	11,704	792.750	9,278,346.00	
UNITED SPIRITS LTD	4,855	844.300	4,099,076.50	
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	2,044	1,610.750	3,292,373.00	
DABUR INDIA LTD	10,335	551.300	5,697,685.50	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	5,978	761.150	4,550,154.70	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	15,323	2,100.750	32,189,792.25	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	1,958	4,676.050	9,155,705.90	
AUROBINDO PHARMA LTD	4,893	638.900	3,126,137.70	
BIOCON LTD	7,019	380.850	2,673,186.15	



CIPLA LTD	8,584	953.150	8,181,839.60	
DIVI'S LABORATORIES LTD	2,316	4,410.100	10,213,791.60	
DR. REDDY'S LABORATORIES	2,045	4,115.450	8,416,095.25	
LUPIN LTD	4,861	725.400	3,526,169.40	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	14,661	900.000	13,194,900.00	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	848	2,732.300	2,316,990.40	
AXIS BANK LTD	42,316	780.700	33,036,101.20	
BANDHAN BANK LTD	10,002	332.750	3,328,165.50	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	31,758	2,210.500	70,201,059.00	
ICICI BANK LTD	94,918	752.200	71,397,319.60	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	10,464	1,728.850	18,090,686.40	
STATE BANK OF INDIA	33,811	494.750	16,727,992.25	
YES BANK LTD	188,310	13.750	2,589,262.50	
BAJAJ FINANCE LTD	5,048	7,005.500	35,363,764.00	
BAJAJ FINSERV LTD	732	15,265.150	11,174,089.80	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	8,282	715.200	5,923,286.40	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	718	2,005.000	1,439,590.00	
MUTHOOT FINANCE LTD	2,010	1,277.050	2,566,870.50	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	2,439	2,113.000	5,153,607.00	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	3,930	804.600	3,162,078.00	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	3,367	1,096.600	3,692,252.20	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	17,668	540.000	9,540,720.00	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	3,722	1,305.750	4,860,001.50	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	6,000	516.950	3,101,700.00	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	8,746	1,091.250	9,544,072.50	
DLF LTD	10,337	364.000	3,762,668.00	
GODREJ PROPERTIES LTD	2,089	1,510.800	3,156,061.20	
HCL TECHNOLOGIES LTD	20,368	1,089.850	22,198,064.80	
INFOSYS LTD	62,021	1,561.100	96,820,983.10	
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	878	4,856.050	4,263,611.90	
MINDTREE LTD	1,101	3,722.550	4,098,527.55	
MPHASIS LTD	1,407	2,794.850	3,932,353.95	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	17,110	3,548.200	60,709,702.00	
TECH MAHINDRA LTD	11,940	1,270.400	15,168,576.00	
WIPRO LTD	25,986	529.350	13,755,689.10	
BHARTI AIRTEL LTD	46,084	739.350	34,072,205.40	

	INDUS TOWERS LTD	9,651	211.100	2,037,326.10	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	7,441	2,824.000	21,013,384.00	
	ADANI TOTAL GAS LTD	5,372	2,420.000	13,000,240.00	
	ADANI TRANSMISSION LTD	5,298	2,615.900	13,859,038.20	
	GAIL INDIA LTD	25,960	157.850	4,097,786.00	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	4,121	372.150	1,533,630.15	
	NTPC LTD	84,726	156.100	13,225,728.60	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	54,806	222.850	12,213,517.10	
	TATA POWER CO LTD	24,009	247.350	5,938,626.15	
	INFO EDGE INDIA LTD	1,370	4,502.450	6,168,356.50	
	インド・ルピー小計	1,579,015		1,308,164,176.95 (2,184,634,176)	
インドネシア・ルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBK P	263,900	3,210.000	847,119,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	28,000	27,625.000	773,500,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	128,000	2,620.000	335,360,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	626,800	865.000	542,182,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	57,500	7,500.000	431,250,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	36,000	10,125.000	364,500,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	179,700	5,200.000	934,440,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD T-RIGHTS	9,461	2,330.000	22,044,130.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	43,500	5,975.000	259,912,500.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	353,700	7,075.000	2,502,427,500.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	112,900	4,920.000	555,468,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	10,800	30,600.000	330,480,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	39,000	7,425.000	289,575,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	87,700	6,300.000	552,510,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	104,500	3,690.000	385,605,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	410,000	1,605.000	658,050,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,029,900	8,000.000	8,239,200,000.00	
	BANK JAGO TBK PT	82,300	12,275.000	1,010,232,500.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	350,300	8,225.000	2,881,217,500.00	
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	124,600	9,500.000	1,183,700,000.00		

	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	1,272,800	4,840.000	6,160,352,000.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	516,500	1,030.000	531,995,000.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	917,400	4,710.000	4,320,954,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	118,900	3,080.000	366,212,000.00	
	インドネシア・ルピア小 計	6,904,161		34,478,286,130.00 (306,856,747)	
ブラジ ル・レア ル	COSAN SA	17,188	22.010	378,307.88	
	PETRO RIO SA	14,300	24.700	353,210.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	69,200	33.140	2,293,288.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	88,400	30.110	2,661,724.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	10,600	14.100	149,460.00	
	BRASKEM SA-PREF A	2,600	41.280	107,328.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	11,600	21.430	248,588.00	
	GERDAU SA-PREF	22,400	27.700	620,480.00	
	SUZANO SA	14,415	51.750	745,976.25	
	VALE SA	75,688	79.080	5,985,407.04	
	WEG SA	31,960	31.210	997,471.60	
	CCR SA	23,400	13.450	314,730.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	11,700	55.350	647,595.00	
	RUMO SA	21,700	18.130	393,421.00	
	ALPARGATAS SA - PREF	2,100	21.170	44,457.00	
	AMERICANAS SA	13,024	26.390	343,703.36	
	LOJAS RENNEN S.A.	16,558	25.000	413,950.00	
	MAGAZINE LUIZA SA	54,700	5.440	297,568.00	
	VIBRA ENERGIA SA	19,480	22.180	432,066.40	
	ATACADA0 SA	8,100	21.400	173,340.00	
	RAIA DROGASIL SA	17,900	22.920	410,268.00	
	AMBEV SA	88,200	15.120	1,333,584.00	
	BRF SA	15,000	13.980	209,700.00	
	JBS SA	14,100	38.080	536,928.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	16,300	20.070	327,141.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	81,219	10.160	825,185.04	
REDE D'OR SAO LUIZ SA	7,400	40.830	302,142.00		
HYPERA SA	6,000	37.550	225,300.00		
BANCO BRADESCO S.A.	26,881	15.760	423,644.56		
BANCO BRADESCO SA-PREF	99,336	19.100	1,897,317.60		
BANCO DO BRASIL S.A.	16,800	34.700	582,960.00		

	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	90,300	25.570	2,308,971.00	
	ITAUSA SA	88,569	9.880	875,061.72	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	114,800	14.120	1,620,976.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	11,700	26.370	308,529.00	
	TOTVS SA	8,800	34.630	304,744.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	8,500	53.650	456,025.00	
	TIM SA	18,200	13.750	250,250.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIEN	6,500	40.240	261,560.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	5,700	39.840	227,088.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	17,846	15.050	268,582.30	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	5,700	46.720	266,304.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	2,550	44.450	113,347.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	16,800	25.760	432,768.00	
	ブラジル・リアル小計	1,314,214		32,370,448.25 (846,707,341)	
チェコ・ コルナ	KOMERCNI BANKA AS	1,270	845.000	1,073,150.00	
	MONETA MONEY BANK AS	4,790	93.700	448,823.00	
	CEZ AS	2,855	971.000	2,772,205.00	
	チェコ・コルナ小計	8,915		4,294,178.00 (24,113,957)	
韓国・ ウォン	GS HOLDINGS	628	43,850.000	27,537,800.00	
	HD HYUNDAI	932	58,400.000	54,428,800.00	
	SK INNOVATION CO LTD	974	212,500.000	206,975,000.00	
	S-OIL CORP	752	104,000.000	78,208,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	2,077	31,900.000	66,256,300.00	
	HYUNDAI STEEL CO	1,449	42,400.000	61,437,600.00	
	KOREA ZINC CO LTD	142	621,000.000	88,182,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	305	147,500.000	44,987,500.00	
	LG CHEM LTD	857	486,000.000	416,502,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	128	247,000.000	31,616,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	286	192,000.000	54,912,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	641	127,500.000	81,727,500.00	
	POSCO HOLDINGS INC	1,389	286,000.000	397,254,000.00	
	SK CHEMICALS CO LTD/NEW	144	125,000.000	18,000,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	526	126,500.000	66,539,000.00	
	SKC CO LTD	348	149,000.000	51,852,000.00	
CJ CORP	168	86,500.000	14,532,000.00		

DOOSAN BOBCAT INC	664	40,450.000	26,858,800.00	
DOOSAN ENERBILITY	6,839	20,400.000	139,515,600.00	
ECOPRO BM CO LTD	183	455,200.000	83,301,600.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	1,373	40,400.000	55,469,200.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	1,302	42,550.000	55,400,100.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,568	43,050.000	67,502,400.00	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	650	95,000.000	61,750,000.00	
LG CORP	1,541	72,800.000	112,184,800.00	
LG ENERGY SOLUTION	407	433,000.000	176,231,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	1,619	108,000.000	174,852,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	2,973	23,600.000	70,162,800.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	10,504	6,050.000	63,549,200.00	
SK INC	731	259,000.000	189,329,000.00	
S-1 CORPORATION	219	67,500.000	14,782,500.00	
CJ LOGISTICS	235	122,000.000	28,670,000.00	
HMM CO LTD	4,708	26,750.000	125,939,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	364	190,000.000	69,160,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	2,905	29,950.000	87,004,750.00	
PAN OCEAN CO LTD	4,527	6,440.000	29,153,880.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	1,442	34,500.000	49,749,000.00	
HANON SYSTEMS	4,138	11,400.000	47,173,200.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	1,252	203,500.000	254,782,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	2,596	182,000.000	472,472,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	609	92,000.000	56,028,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	313	91,200.000	28,545,600.00	
KIA CORP	4,948	79,600.000	393,860,800.00	
COWAY CO LTD	925	69,200.000	64,010,000.00	
F&F CO LTD / NEW	290	126,500.000	36,685,000.00	
HLB INC	2,030	29,200.000	59,276,000.00	
LG ELECTRONICS INC	2,019	119,000.000	240,261,000.00	
KANGWON LAND INC	2,078	26,400.000	54,859,200.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	680	80,100.000	54,468,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	172	93,100.000	16,013,200.00	
BGF RETAIL CO LTD	193	183,000.000	35,319,000.00	
E-MART INC	326	132,500.000	43,195,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	125	418,000.000	52,250,000.00	
KT&G CORP	2,245	82,400.000	184,988,000.00	

ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	373	93,500.000	34,875,500.00	
AMOREPACIFIC CORP	583	158,500.000	92,405,500.00	
AMOREPACIFIC GROUP	473	45,950.000	21,734,350.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	181	883,000.000	159,823,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	35	489,000.000	17,115,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	1,452	57,700.000	83,780,400.00	
SD BIOSENSOR INC	604	46,100.000	27,844,400.00	
ALTEOGEN INC	312	53,600.000	16,723,200.00	
CELLTRION INC	1,861	155,500.000	289,385,500.00	
CELLTRION PHARM INC	347	83,100.000	28,835,700.00	
GREEN CROSS CORP	79	181,000.000	14,299,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	88	303,500.000	26,708,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	314	793,000.000	249,002,000.00	
SEEGENE INC	713	40,700.000	29,019,100.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	383	86,700.000	33,206,100.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	383	136,000.000	52,088,000.00	
YUHAN CORP	798	58,800.000	46,922,400.00	
HANA FINANCIAL GROUP	5,678	47,450.000	269,421,100.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	4,084	11,550.000	47,170,200.00	
KAKAOBANK CORP	1,587	42,450.000	67,368,150.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	7,386	60,000.000	443,160,000.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	8,270	42,050.000	347,753,500.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	9,935	15,800.000	156,973,000.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	873	72,500.000	63,292,500.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	824	37,300.000	30,735,200.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	5,528	6,510.000	35,987,280.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	4,496	8,100.000	36,417,600.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	2,376	10,500.000	24,948,000.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	982	39,350.000	38,641,700.00	
DB INSURANCE CO LTD	912	69,800.000	63,657,600.00	
MERITZ FIRE & MARINE INSURAN	969	44,450.000	43,072,050.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	514	210,000.000	107,940,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	1,423	64,900.000	92,352,700.00	

	SAMSUNG SDS CO LTD	582	137,000.000	79,734,000.00	
	ILJIN MATERIALS CO LTD	385	83,200.000	32,032,000.00	
	L&F CO LTD	375	225,000.000	84,375,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	3,885	18,100.000	70,318,500.00	
	LG INNOTEK CO LTD	237	372,500.000	88,282,500.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1,078	163,000.000	175,714,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	87,704	66,300.000	5,814,775,200.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	15,221	59,500.000	905,649,500.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	1,024	578,000.000	591,872,000.00	
	SK HYNIX INC	10,083	108,000.000	1,088,964,000.00	
	SK SQUARE CO LTD	1,963	54,500.000	106,983,500.00	
	LG UPLUS CORP	4,555	14,600.000	66,503,000.00	
	SK TELECOM	352	59,600.000	20,979,200.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	4,289	21,200.000	90,926,800.00	
	CHEIL WORLDWIDE INC	1,193	25,000.000	29,825,000.00	
	CJ ENM CO LTD	144	123,900.000	17,841,600.00	
	HYBE CO LTD	332	250,500.000	83,166,000.00	
	KAKAO CORP	5,811	89,700.000	521,246,700.00	
	KAKAO GAMES CORP	499	60,700.000	30,289,300.00	
	KRAFTON INC	383	242,500.000	92,877,500.00	
	NAVER CORP	2,286	288,500.000	659,511,000.00	
	NCSOFT CORP	321	412,500.000	132,412,500.00	
	NETMARBLE CORP	337	96,200.000	32,419,400.00	
	PEARL ABYSS CORP	498	91,600.000	45,616,800.00	
	韓国・ウォン小計	289,792		19,490,671,860.00 (1,993,895,731)	
マレーシア・リンギット	DIALOG GROUP BHD	66,000	2.570	169,620.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	5,000	21.080	105,400.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	43,400	10.120	439,208.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	59,200	6.170	365,264.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	8,100	7.610	61,641.00	
	SIME DARBY BERHAD	47,100	2.340	110,214.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	14,700	6.750	99,225.00	
	MISC BHD	28,500	7.760	221,160.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	10,000	3.920	39,200.00	
	GENTING BHD	41,600	4.520	188,032.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	43,800	2.930	128,334.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	1,200	21.620	25,944.00	
	IOI CORP BHD	49,500	4.730	234,135.00	

	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	8,600	29.000	249,400.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	1,500	132.500	198,750.00	
	PPB GROUP BERHAD	13,340	17.220	229,714.80	
	QL RESOURCES BHD	13,050	5.000	65,250.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	37,800	5.340	201,852.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	37,700	4.510	170,027.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	27,500	6.560	180,400.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	97,900	1.710	167,409.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	39,300	3.630	142,659.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	127,000	5.160	655,320.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	13,400	20.820	278,988.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	5,700	19.280	109,896.00	
	MALAYAN BANKING BHD	89,300	8.890	793,877.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	267,000	4.710	1,257,570.00	
	RHB BANK BHD	28,900	5.970	172,533.00	
	INARI AMERTRON BHD	52,900	2.740	144,946.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	52,900	3.440	181,976.00	
	DIGI.COM BHD	58,600	3.780	221,508.00	
	MAXIS BHD	39,200	3.810	149,352.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	16,000	4.790	76,640.00	
	PETRONAS GAS BHD	14,900	16.920	252,108.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	41,200	8.880	365,856.00	
	マレーシア・リンギット 小計	1,501,790		8,453,408.80	
				(247,897,057)	
南アフリ カ・ラン ド	EXXARO RESOURCES LTD	5,088	209.500	1,065,936.00	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	2,473	241.610	597,501.53	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	973	1,657.880	1,613,117.24	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	7,292	318.150	2,319,949.80	
	GOLD FIELDS LTD	16,821	206.050	3,465,967.05	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	8,544	62.900	537,417.60	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	15,377	191.580	2,945,925.66	
	KUMBA IRON ORE LTD	1,182	490.300	579,534.60	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	5,961	176.000	1,049,136.00	
	SASOL LTD	10,385	358.230	3,720,218.55	
	SIBANYE STILLWATER LTD	48,336	53.000	2,561,808.00	
	BIDVEST GROUP LTD	4,831	215.950	1,043,254.45	
	MR PRICE GROUP LTD	4,283	217.220	930,353.26	
	NASPERS LTD-N SHS	4,051	1,502.880	6,088,166.88	



	PEPKOR HOLDINGS LTD	21,607	21.420	462,821.94	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	16,661	59.210	986,497.81	
	BID CORP LTD	6,489	319.240	2,071,548.36	
	CLICKS GROUP LTD	4,102	312.640	1,282,449.28	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	9,683	232.800	2,254,202.40	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	4,180	163.260	682,426.80	
	TIGER BRANDS LTD	3,772	152.550	575,418.60	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	6,974	171.090	1,193,181.66	
	ABSA GROUP LTD	13,218	165.600	2,188,900.80	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	1,536	2,208.740	3,392,624.64	
	NEDBANK GROUP LTD	8,893	217.130	1,930,937.09	
	STANDARD BANK GROUP LTD	25,279	168.600	4,262,039.40	
	FIRSTRAND LTD	94,200	67.850	6,391,470.00	
	REINET INVESTMENTS SCA	2,291	303.080	694,356.28	
	REMGRO LTD	8,840	139.910	1,236,804.40	
	DISCOVERY LTD	8,625	158.120	1,363,785.00	
	MOMENTUM METROPOLITAN HOLDIN	3,349	16.700	55,928.30	
	OLD MUTUAL LTD	78,650	12.110	952,451.50	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	12,793	26.150	334,536.95	
	SANLAM LTD	33,606	67.600	2,271,765.60	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	8,918	94.560	843,286.08	
	MTN GROUP LTD	31,150	165.330	5,150,029.50	
	VODACOM GROUP LTD	11,515	147.590	1,699,498.85	
	MULTICHOICE GROUP LTD	6,283	127.030	798,129.49	
	南アフリカ・ランド小計	558,211		71,593,377.35 (582,054,158)	
タイ・ パーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL- NVDR	25,100	144.500	3,626,950.00	
	PTT PCL-NVDR	186,600	37.000	6,904,200.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	24,800	53.750	1,333,000.00	
	INDORAMA VENTURES PCL- NVDR	35,700	45.500	1,624,350.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL- NVDR	44,800	49.000	2,195,200.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	27,300	56.500	1,542,450.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	14,900	358.000	5,334,200.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC- NVDR	75,200	67.750	5,094,800.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR	126,600	8.300	1,050,780.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL- NVDR	131,900	9.100	1,200,290.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	184,500	4.940	911,430.00	

MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	52,100	34.500	1,797,450.00	
CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	36,791	40.000	1,471,640.00	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	114,300	15.200	1,737,360.00	
PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	50,100	24.800	1,242,480.00	
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	19,000	34.500	655,500.00	
CP ALL PCL-NVDR	110,400	65.250	7,203,600.00	
CARABAO GROUP PCL-NVDR	5,400	108.500	585,900.00	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	73,500	23.700	1,741,950.00	
OSOTSPA PCL-NVDR	16,200	34.500	558,900.00	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	58,800	16.900	993,720.00	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	168,700	26.750	4,512,725.00	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	8,000	165.000	1,320,000.00	
SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	13,000	24.500	318,500.00	
KRUNG THAI BANK - NVDR	58,400	14.300	835,120.00	
BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	43,300	20.100	870,330.00	
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	14,300	57.250	818,675.00	
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	16,200	48.500	785,700.00	
SRISAWAD CORP PCL-NVDR	11,800	54.000	637,200.00	
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	33,700	61.500	2,072,550.00	
LAND & HOUSES PUB - NVDR	176,900	9.350	1,654,015.00	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	5,700	388.000	2,211,600.00	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	20,900	216.000	4,514,400.00	
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	18,700	69.750	1,304,325.00	
TRUE CORP PCL-NVDR	259,200	4.800	1,244,160.00	
B GRIMM POWER PCL-NVDR	20,900	33.250	694,925.00	
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	3,800	169.000	642,200.00	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	24,900	89.750	2,234,775.00	
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	9,600	68.750	660,000.00	
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	49,000	48.750	2,388,750.00	
RATCH GROUP PCL-NVDR	19,600	44.500	872,200.00	

タイ・パーツ小計		2,390,591		79,398,300.00 (296,949,642)	
ポーランド・ズロチ	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	5,001	72.920	364,672.92	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	28,955	6.320	182,995.60	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	2,754	140.600	387,212.40	
	LPP SA	19	9,990.000	189,810.00	
	ALLEGRO.EU SA	6,626	27.055	179,266.43	
	DINO POLSKA SA	819	315.600	258,476.40	
	BANK PEKAO SA	3,299	102.250	337,322.75	
	MBANK SA	302	319.000	96,338.00	
	PKO BANK POLSKI SA	15,261	35.260	538,102.86	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	565	271.400	153,341.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	10,870	31.800	345,666.00	
	ORANGE POLSKA SA	15,737	7.146	112,456.60	
	PGE SA	19,508	9.602	187,315.81	
	CD PROJEKT SA	1,469	130.720	192,027.68	
CYFROWY POLSAT SA	5,742	25.800	148,143.60		
ポーランド・ズロチ小計		116,927		3,673,148.05 (108,309,382)	
ハンガリー・フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	8,186	3,010.000	24,639,860.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	2,331	6,690.000	15,594,390.00	
	OTP BANK PLC	4,109	10,590.000	43,514,310.00	
ハンガリー・フォリント小計		14,626		83,748,560.00 (30,793,341)	
ユーロ	FF GROUP	123	4.800	590.40	
	OPAP SA	3,519	14.570	51,271.83	
	JUMBO SA	2,111	15.150	31,981.65	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	37,227	1.180	43,927.86	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	49,209	1.070	52,653.63	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	4,197	18.040	75,713.88	
	PUBLIC POWER CORP	4,579	8.180	37,456.22	
ユーロ小計		100,965		293,595.47 (40,187,348)	
合計		41,416,549		13,549,402,847 (13,549,402,847)	

(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	42銘柄	2.5%	3.6%
香港・ドル	株式	205銘柄	16.5%	24.4%
台湾・ドル	株式	86銘柄	12.5%	18.5%
エジプト・ポンド	株式	4銘柄	0.0%	0.1%
トルコ・リラ	株式	11銘柄	0.3%	0.4%
メキシコ・ペソ	株式	17銘柄	1.4%	2.1%
フィリピン・ペソ	株式	19銘柄	0.6%	0.9%
チリ・ペソ	株式	11銘柄	0.4%	0.6%
コロンビア・ペソ	株式	5銘柄	0.2%	0.3%
インド・ルピー	株式	106銘柄	10.9%	16.1%
インドネシア・ルピア	株式	24銘柄	1.5%	2.3%
ブラジル・リアル	株式	44銘柄	4.2%	6.2%
チェコ・コルナ	株式	3銘柄	0.1%	0.2%
韓国・ウォン	株式	111銘柄	10.0%	14.7%
マレーシア・リングギット	株式	35銘柄	1.2%	1.8%
南アフリカ・ランド	株式	38銘柄	2.9%	4.3%
タイ・バーツ	株式	41銘柄	1.5%	2.2%
ポーランド・ズロチ	株式	15銘柄	0.5%	0.8%
ハンガリー・フォリント	株式	3銘柄	0.2%	0.2%
ユーロ	株式	7銘柄	0.2%	0.3%

## (b)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オフショア・人民元	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	1,000,000.00	38,760,000.00	
		オフショア・人民元小計	1,000,000.00	38,760,000.00 (752,699,820)	
投資信託受益証券合計				752,699,820 (752,699,820)	
投資証券	アメリカ・ドル	ISHARES MSCI KUWAIT ETF	25,744.00	1,038,770.40	
		ISHARES MSCI QATAR ETF	53,189.00	1,280,791.12	
		ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	117,107.00	5,817,875.76	
		ISHARES MSCI UAE ETF	100,055.00	1,894,041.15	
	アメリカ・ドル小計		296,095.00	10,031,478.43 (1,280,016,649)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB-CPO	263,900.00	2,348,710.00	
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	8,775.00	992,540.25	
FOMENTO ECONOMICO MEXICANA-UBD		36,500.00	5,618,810.00		

	GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	40,100.00	1,614,827.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	4,184.00	250,119.52	
	OPERADORA DE SITES MEX- A-1	30,400.00	784,928.00	
	TRUST FIBRA UNO	52,800.00	1,232,880.00	
	メキシコ・ペソ小計	436,659.00	12,842,814.77 (81,047,151)	
ブラジル・リアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	23,000.00	577,760.00	
	BANCO INTER SA-UNITS	5,700.00	97,527.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	6,300.00	211,869.00	
	ENERGISA SA-UNITS	3,100.00	149,110.00	
	KLABIN SA - UNIT	12,000.00	265,920.00	
	ブラジル・リアル小計	50,100.00	1,302,186.00 (34,061,019)	
南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	57,305.00	794,820.35	
	南アフリカ・ランド小計	57,305.00	794,820.35 (6,461,889)	
投資証券合計			1,401,586,708 (1,401,586,708)	
合計			2,154,286,528 (2,154,286,528)	

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

通貨	銘柄数		組入 投資信託受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券	4銘柄	-	6.4%	59.4%
メキシコ・ペソ	投資証券	7銘柄	-	0.4%	3.8%
ブラジル・リアル	投資証券	5銘柄	-	0.2%	1.6%
オフショア・人民元	投資信託受益証券	1銘柄	3.8%	-	34.9%
南アフリカ・ランド	投資証券	1銘柄	-	0.0%	0.3%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

Jリート・インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

(2021年4月26日現在)

(2022年4月26日現在)

資産の部

流動資産

金銭信託

29,114,056

960,122

コール・ローン	66,809,626	48,427,834
投資証券	8,029,616,750	8,247,387,550
派生商品評価勘定	4,736,400	2,395,600
未収入金	2,631,744	-
未収配当金	58,652,103	69,756,673
差入委託証拠金	3,330,000	2,330,000
流動資産合計	8,194,890,679	8,371,257,779
資産合計	8,194,890,679	8,371,257,779
負債の部		
流動負債		
前受金	4,743,000	2,440,000
未払解約金	68,058,794	2,949,776
未払利息	193	-
その他未払費用	2,229	169
流動負債合計	72,804,216	5,389,945
負債合計	72,804,216	5,389,945
純資産の部		
元本等		
元本	3,071,522,148	3,142,280,407
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	5,050,564,315	5,223,587,427
元本等合計	8,122,086,463	8,365,867,834
純資産合計	8,122,086,463	8,365,867,834
負債純資産合計	8,194,890,679	8,371,257,779

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年4月27日 至 2022年4月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

2. デリバティブの評価基準及び評価方法	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26日現在)	(2022年4月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	3,071,522,148口	3,142,280,407口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.6443円 (1万口当たりの純資産額26,443円)	1口当たり純資産額 2.6624円 (1万口当たりの純資産額26,624円)

## (金融商品に関する注記)

## ・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年4月27日 至 2022年4月26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年4月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>



(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	リート指数先物取引 買建				
	TREIT先物	56,628,600	-	61,365,000	4,736,400
	小計	56,628,600	-	61,365,000	4,736,400
合計		56,628,600	-	61,365,000	4,736,400

(2022年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	リート指数先物取引 買建				
	TREIT先物 0406 月	37,204,400	-	39,600,000	2,395,600
	小計	37,204,400	-	39,600,000	2,395,600
合計		37,204,400	-	39,600,000	2,395,600

(注) 1. 時価の算定方法

リート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)リート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27日 至 2022年4月26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26日現在)	
開示対象ファンドの 期首における当該親投資信託の元本額	2,079,734,759円

同期中における追加設定元本額	2,566,048,223円
同期中における一部解約元本額	1,574,260,834円
2021年4月26日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	316,132,317円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	348,559,330円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	238,816,451円
イオン・バランス戦略ファンド	84,560,850円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	1,588,375,824円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	9,834,653円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	35,461,155円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	25,278,674円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	80,153,697円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	41,281,247円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	33,683,493円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	15,113,869円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,448,736円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	20,024,548円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	50,433,479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>	31,132,085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>	82,301,805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>	68,929,935円
合計	3,071,522,148円

(2022年4月26日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	3,071,522,148円
同期中における追加設定元本額	2,198,779,564円
同期中における一部解約元本額	2,128,021,305円
2022年4月26日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	74,332,453円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	144,802,192円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	113,294,756円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	1,953,407,139円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	13,792,150円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	55,523,511円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	40,771,712円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	135,968,837円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	74,606,058円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	58,817,013円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	24,699,702円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,673,254円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	58,102,181円
日興FWS・Jリートインデックス	181,297,356円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	1,894,768円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	3,536,609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>	47,867,823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>	32,115,891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>	40,704,739円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%)<適格機関投資家限定>	85,072,263円
合計	3,142,280,407円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	149	19,772,300	
	サンケイリアルエステート投資法人	235	23,406,000	
	SOSILA物流リート投資法人	347	54,305,500	
	東海道リート投資法人	55	6,314,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	258	167,442,000	
	森ヒルズリート投資法人	882	130,095,000	
	産業ファンド投資法人	1,063	202,076,300	
	アドバンス・レジデンス投資法人	749	268,142,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	535	111,761,500	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	400	166,200,000	
	GLP投資法人	2,426	426,976,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	349	112,552,500	
	日本プロロジスリート投資法人	1,226	449,329,000	
	星野リゾート・リート投資法人	126	85,428,000	
	Oneリート投資法人	129	35,642,700	
	イオンリート投資法人	882	130,712,400	
	ヒューリックリート投資法人	698	111,889,400	
	日本リート投資法人	232	86,072,000	
	積水ハウス・リート投資法人	2,278	177,000,600	
	トーセイ・リート投資法人	154	20,512,800	
ケネディクス商業リート投資法人	298	81,324,200		

ヘルスケア&メディカル投資法人	182	28,628,600	
サムティ・レジデンシャル投資法人	186	24,273,000	
野村不動産マスターファンド投資法人	2,423	398,825,800	
いちごホテルリート投資法人	120	10,908,000	
ラサールロジポート投資法人	919	162,203,500	
スターアジア不動産投資法人	777	45,765,300	
マリモ地方創生リート投資法人	85	11,237,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	296	167,536,000	
大江戸温泉リート投資法人	116	7,957,600	
投資法人みらい	908	46,217,200	
森トラスト・ホテルリート投資法人	176	22,704,000	
三菱地所物流リート投資法人	218	102,024,000	
CREロジスティクスファンド投資法人	288	57,456,000	
ザイマックス・リート投資法人	119	14,672,700	
タカラレーベン不動産投資法人	294	35,074,200	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	291	46,792,800	
日本ビルファンド投資法人	873	594,513,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	749	474,117,000	
日本都市ファンド投資法人	3,781	390,955,400	
オリックス不動産投資法人	1,492	260,204,800	
日本プライムリアルティ投資法人	512	201,472,000	
NTT都市開発リート投資法人	719	111,229,300	
東急リアル・エステート投資法人	504	91,929,600	
グローバル・ワン不動産投資法人	523	59,255,900	
ユナイテッド・アーバン投資法人	1,687	242,928,000	
森トラスト総合リート投資法人	537	75,824,400	
インヴィンシブル投資法人	3,305	142,941,250	
フロンティア不動産投資法人	262	132,834,000	
平和不動産リート投資法人	486	72,219,600	
日本ロジスティクスファンド投資法人	506	162,426,000	
福岡リート投資法人	386	62,763,600	
ケネディクス・オフィス投資法人	233	164,032,000	

いちごオフィスリート投資法人	613	52,227,600	
大和証券オフィス投資法人	156	114,504,000	
阪急阪神リート投資法人	337	50,314,100	
スターツプロシード投資法人	116	26,958,400	
大和ハウスリート投資法人	1,125	355,500,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	2,300	154,100,000	
大和証券リビング投資法人	1,002	114,228,000	
ジャパンエクセレント投資法人	697	90,679,700	
投資証券 小計		8,247,387,550	
合 計		8,247,387,550	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

## 外国リート・インデックス・マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2021年4月26日現在)	(2022年4月26日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	44,482,747	257,992,966
金銭信託	28,588,674	2,592,223
コール・ローン	65,604,005	130,749,860
投資証券	11,519,480,828	23,371,768,716
派生商品評価勘定	17,814	-
未収入金	57,714,478	1,057,708
未収配当金	11,685,275	19,378,538
流動資産合計	11,727,573,821	23,783,540,011
資産合計	11,727,573,821	23,783,540,011
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	49,052	1,182,626
未払解約金	142,622,000	11,984,072
未払利息	189	-
その他未払費用	547	220
流動負債合計	142,671,788	13,166,918
負債合計	142,671,788	13,166,918
純資産の部		
元本等		
元本	4,897,225,610	7,379,512,147
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	6,687,676,423	16,390,860,946
元本等合計	11,584,902,033	23,770,373,093
純資産合計	11,584,902,033	23,770,373,093
負債純資産合計	11,727,573,821	23,783,540,011

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年4月27日 至 2022年4月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年4月26日現在)	(2022年4月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	4,897,225,610口	7,379,512,147口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.3656円 (1万口当たりの純資産額23,656円)	1口当たり純資産額 3.2211円 (1万口当たりの純資産額32,211円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年4月27日 至 2022年4月26日

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

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年4月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	2,500,000	-	2,499,953	47
	イギリス・ポンド	500,000	-	499,947	53
	オーストラリア・ドル	800,000	-	799,894	106
	ユーロ	500,000	-	499,985	15
	小計	4,300,000	-	4,299,779	221
	売建				
	アメリカ・ドル	37,991,360	-	37,976,928	14,432
	イギリス・ポンド	2,839,151	-	2,846,004	6,853
	オーストラリア・ドル	3,410,872	-	3,431,290	20,418
	カナダ・ドル	949,850	-	952,152	2,302
	シンガポール・ドル	1,785,168	-	1,790,118	4,950
	ニュージーランド・ドル	1,245,808	-	1,243,028	2,780



	ユーロ	2,205,070	-	2,219,378	14,308
	香港・ドル	1,196,002	-	1,195,400	602
	小計	51,623,281	-	51,654,298	31,017
	合計	55,923,281	-	55,954,077	31,238

(2022年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	78,000,000	-	77,319,579	680,421
	カナダ・ドル	1,800,000	-	1,782,470	17,530
	オーストラリア・ドル	9,300,000	-	9,098,200	201,800
	香港・ドル	1,500,000	-	1,485,772	14,228
	シンガポール・ドル	3,000,000	-	2,963,276	36,724
	イギリス・ポンド	6,800,000	-	6,650,632	149,368
	ユーロ	4,800,000	-	4,717,445	82,555
	小計	105,200,000	-	104,017,374	1,182,626
	合計	105,200,000	-	104,017,374	1,182,626

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2021年4月27日 至 2022年4月26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26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	3,351,152,062円
同期中における追加設定元本額	2,408,226,049円
同期中における一部解約元本額	862,152,501円
2021年4月26日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	36,052,341円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	44,692,972円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	29,319,643円
イオン・バランス戦略ファンド	44,687,417円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	4,353,843,871円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	3,924,728円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	40,667,543円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	28,606,664円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	90,223,455円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	46,713,633円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	37,645,676円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	51,093,218円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	583,824円
三井住友D S・外国リートインデックス年金ファンド	17,098,546円
S M A M・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	46,391,095円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	25,680,984円
合計	4,897,225,610円

(2022年4月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	4,897,225,610円
同期中における追加設定元本額	3,515,870,384円
同期中における一部解約元本額	1,033,583,847円
2022年4月26日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	14,691,068円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	15,848,872円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	10,883,264円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	6,414,868,609円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	4,238,171円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	50,724,245円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	36,847,018円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	121,474,215円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	63,639,316円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	52,163,859円

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	63,412,875円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	551,319円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド	132,295,590円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	65,236,916円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	168,671,758円
三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド	3,412,797円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	37,893,158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>	43,784,034円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%)<適格機関投資家限定>	78,875,063円
合計	7,379,512,147円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	8,247.00	173,516.88	
		AGREE REALTY CORP	8,163.00	578,838.33	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	6,758.00	147,256.82	
		ALEXANDER'S INC	300.00	78,987.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	16,644.00	3,212,292.00	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	2,165.00	42,260.80	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	5,414.00	197,881.70	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	15,168.00	982,128.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	34,264.00	1,412,019.44	
		AMERICOLD REALTY TRUST	30,833.00	869,182.27	
		APARTMENT INCOME REIT CO	18,454.00	994,116.98	
		APARTMENT INVT & MGMT CO - A	15,893.00	107,277.75	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	22,636.00	410,617.04	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	8,429.00	121,293.31	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	2,515.00	20,396.65	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	15,902.00	3,950,374.84	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,745.00	99,841.70	
		BOSTON PROPERTIES INC	16,013.00	2,014,755.66	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	8,400.00	53,256.00	

BRANDYWINE REALTY TRUST	20,191.00	254,002.78	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	33,499.00	875,998.85	
BROADSTONE NET LEASE INC	19,744.00	432,985.92	
BRT APARTMENTS CORP	500.00	11,295.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	11,391.00	1,870,402.20	
CARETRUST REIT INC	9,346.00	157,853.94	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	3,648.00	105,500.16	
CEDAR REALTY TRUST INC	2,376.00	67,739.76	
CENTERSPACE	1,542.00	152,843.04	
CHATHAM LODGING TRUST	5,557.00	80,632.07	
CITY OFFICE REIT INC	4,603.00	72,727.40	
CLIPPER REALTY INC	800.00	7,208.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3,216.00	126,292.32	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	11,896.00	334,872.40	
COUSINS PROPERTIES INC	17,057.00	664,711.29	
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY T	2,658.00	19,084.44	
CTO REALTY GROWTH INC	310.00	19,740.80	
CUBESMART	24,403.00	1,275,056.75	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	26,676.00	286,233.48	
DIGITAL REALTY TRUST INC	32,125.00	4,868,865.00	
DIGITALBRIDGE GROUP INC	54,264.00	388,530.24	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	23,884.00	58,993.48	
DOUGLAS EMMETT INC	20,496.00	647,058.72	
DUKE REALTY CORP	43,684.00	2,591,771.72	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	20,000.00	2,740.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	9,769.00	196,747.66	
EASTGROUP PROPERTIES INC	4,512.00	929,156.16	
EMPIRE STATE REALTY TRUST- A	12,815.00	113,412.75	
EPR PROPERTIES	7,974.00	441,998.82	
EQUINIX INC	10,180.00	7,660,653.60	
EQUITY COMMONWEALTH	12,245.00	331,227.25	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	19,581.00	1,600,159.32	
EQUITY RESIDENTIAL	39,044.00	3,524,892.32	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	12,429.00	317,933.82	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	7,327.00	2,550,455.43	
EXTRA SPACE STORAGE INC	14,995.00	3,127,057.30	

FARMLAND PARTNERS INC	4,666.00	69,196.78	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	7,993.00	964,195.59	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	14,178.00	903,422.16	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	8,024.00	236,467.28	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	6,015.00	32,300.55	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	26,764.00	1,244,526.00	
GETTY REALTY CORP	5,036.00	141,964.84	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	3,102.00	68,337.06	
GLADSTONE LAND CORP	4,464.00	173,917.44	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	5,669.00	87,019.15	
GLOBAL NET LEASE INC	13,146.00	196,795.62	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	17,535.00	488,875.80	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	25,145.00	789,050.10	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	60,975.00	2,090,223.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	2,876.00	28,156.04	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	12,194.00	536,170.18	
HOST HOTELS & RESORTS INC	82,608.00	1,728,985.44	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	17,289.00	443,117.07	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	24,950.00	695,606.00	
INDUS REALTY TRUST INC	823.00	60,087.23	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	6,274.00	122,782.18	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,230.00	506,464.00	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	8,406.00	255,458.34	
INVITATION HOMES INC	66,947.00	2,866,001.07	
IRON MOUNTAIN INC	32,272.00	1,798,195.84	
JBG SMITH PROPERTIES	12,389.00	343,423.08	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	130,900.00	96,211.50	
KILROY REALTY CORP	12,366.00	934,003.98	
KIMCO REALTY CORP	70,199.00	1,798,498.38	
KITE REALTY GROUP TRUST	24,850.00	557,137.00	
LIFE STORAGE INC	9,278.00	1,332,691.92	
LTC PROPERTIES INC	5,036.00	179,785.20	
LXP INDUSTRIAL TRUST	31,951.00	422,711.73	
MACERICH CO/THE	23,870.00	324,393.30	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	245,900.00	156,146.50	

MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	67,477.00	1,251,023.58	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	13,220.00	2,710,364.40	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	19,913.00	924,361.46	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	9,133.00	570,447.18	
NATL HEALTH INVESTORS INC	4,815.00	260,780.40	
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	17,023.00	133,630.55	
NETSTREIT CORP	4,793.00	111,533.11	
NEXPOINT RESIDENTIAL	2,355.00	210,913.80	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	5,071.00	118,610.69	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	26,452.00	734,307.52	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,352.00	71,830.08	
ORION OFFICE REIT INC	5,199.00	70,862.37	
PARAMOUNT GROUP INC	20,155.00	202,759.30	
PARK HOTELS & RESORTS INC	25,733.00	515,431.99	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	15,094.00	380,821.62	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	5,400.00	3,180.60	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	13,145.00	464,281.40	
PHYSICIANS REALTY TRUST	23,370.00	410,844.60	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	14,040.00	237,135.60	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,774.00	120,782.20	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	1,424.00	24,763.36	
PREFERRED APARTMENT COMMUNIT	6,243.00	155,575.56	
PRIME US REIT	54,200.00	40,379.00	
PROLOGIS INC	83,890.00	14,070,869.70	
PS BUSINESS PARKS INC/MD	2,274.00	426,375.00	
PUBLIC STORAGE	17,249.00	6,882,351.00	
REALTY INCOME CORP	64,430.00	4,687,282.50	
REGENCY CENTERS CORP	17,939.00	1,259,317.80	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	12,609.00	247,010.31	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	18,059.00	1,469,280.24	
RLJ LODGING TRUST	17,225.00	249,073.50	
RPT REALTY	8,262.00	114,841.80	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	6,226.00	603,174.88	

	SABRA HEALTH CARE REIT INC	28,223.00	348,554.05	
	SAFEHOLD INC	1,242.00	58,299.48	
	SAUL CENTERS INC	894.00	48,463.74	
	SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	3,468.00	39,396.48	
	SERVICE PROPERTIES TRUST	17,194.00	146,836.76	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	37,439.00	4,728,171.31	
	SITE CENTERS CORP	18,028.00	303,411.24	
	SL GREEN REALTY CORP	7,052.00	529,605.20	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	14,917.00	681,557.73	
	STAG INDUSTRIAL INC	19,176.00	778,162.08	
	STORE CAPITAL CORP	26,534.00	788,855.82	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	14,098.00	137,596.48	
	SUN COMMUNITIES INC	13,110.00	2,477,790.00	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	24,669.00	306,142.29	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	10,751.00	187,282.42	
	TERRENO REALTY CORP	8,564.00	659,513.64	
	UDR INC	33,731.00	1,949,651.80	
	UMH PROPERTIES INC	6,284.00	152,072.80	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,344.00	75,815.04	
	URBAN EDGE PROPERTIES	11,117.00	211,334.17	
	URSTADT BIDDLE - CLASS A	2,927.00	53,593.37	
	VENTAS INC	45,132.00	2,627,585.04	
	VERIS RESIDENTIAL INC	7,798.00	129,914.68	
	VICI PROPERTIES INC	72,348.00	2,172,610.44	
	VORNADO REALTY TRUST	17,599.00	728,774.59	
	WASHINGTON REIT	10,790.00	274,821.30	
	WELLTOWER INC	49,154.00	4,697,156.24	
	WHITESTONE REIT	4,511.00	57,785.91	
	WP CAREY INC	21,800.00	1,845,806.00	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	11,870.00	233,482.90	
	アメリカ・ドル小計	2,963,308.00	141,469,684.81 (18,051,531,782)	
カナダ・ ドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	7,021.00	306,887.91	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	9,662.00	127,538.40	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	1,715.00	24,301.55	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,190.00	179,660.80	

BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	13,622.00	58,165.94	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	9,830.00	506,834.80	
CHOICE PROPERTIES REIT	17,893.00	273,762.90	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	5,107.00	92,334.56	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	4,551.00	81,963.51	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	12,411.00	194,852.70	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2,169.00	57,478.50	
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	11,377.00	54,609.60	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	10,775.00	187,592.75	
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3,563.00	348,568.29	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	16,425.00	211,389.75	
INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	1,387.00	12,150.12	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	6,178.00	92,175.76	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	8,107.00	169,841.65	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,447.00	28,983.41	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1,557.00	29,069.19	
NEXUS INDUSTRIAL REIT	4,345.00	57,527.80	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	12,305.00	167,348.00	
PLAZA RETAIL REIT	8,509.00	41,268.65	
PRIMARIS REIT	6,318.00	88,388.82	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	16,598.00	407,646.88	
SLATE GROCERY REIT-CL U	3,196.00	51,583.44	
SLATE OFFICE REIT	3,663.00	18,608.04	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	7,064.00	226,401.20	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	9,177.00	191,248.68	
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4,770.00	33,342.30	



	カナダ・ドル小計	223,932.00	4,321,525.90 (433,060,110)	
オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	32,980.00	110,483.00	
	ARENA REIT	45,981.00	224,847.09	
	BWP TRUST	45,015.00	188,162.70	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	64,710.00	178,599.60	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	53,468.00	211,198.60	
	CENTURIA OFFICE REIT	43,559.00	99,314.52	
	CHARTER HALL GROUP	56,632.00	895,918.24	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	73,852.00	398,800.80	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	62,449.00	275,400.09	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	37,955.00	154,856.40	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	158,718.00	138,084.66	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	30,237.00	104,620.02	
	DEXUS/AU	122,668.00	1,337,081.20	
	GDI PROPERTY GROUP	43,204.00	48,388.48	
	GOODMAN GROUP	194,415.00	4,592,082.30	
	GPT GROUP	215,806.00	1,096,294.48	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	30,439.00	135,149.16	
	HEALTHCO REIT	51,410.00	99,735.40	
	HOME CONSORTIUM LTD	16,399.00	117,252.85	
	HOMEKO DAILY NEEDS REIT	187,797.00	271,366.66	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	15,921.00	63,843.21	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	39,965.00	192,231.65	
	IRONGATE GROUP	42,404.00	81,415.68	
	MIRVAC GROUP	438,177.00	1,051,624.80	
	NATIONAL STORAGE REIT	109,680.00	297,232.80	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	89,106.00	84,650.70	
RURAL FUNDS GROUP	52,739.00	160,326.56		
SCENTRE GROUP	577,531.00	1,692,165.83		
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	116,511.00	361,184.10		
STOCKLAND	270,858.00	1,124,060.70		
VICINITY CENTRES	454,143.00	849,247.41		
WAYPOINT REIT	76,045.00	207,602.85		
	オーストラリア・ドル小計	3,850,774.00	16,843,222.54 (1,545,702,532)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	239,000.00	826,940.00	
	FORTUNE REIT	152,000.00	1,042,720.00	
	LINK REIT	237,100.00	16,122,800.00	
	PROSPERITY REIT	178,000.00	480,600.00	

	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	110,000.00	420,200.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	230,000.00	715,300.00	
	香港・ドル小計	1,146,100.00	19,608,560.00 (318,835,186)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT	38,300.00	54,769.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	365,800.00	1,046,188.00	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	205,555.00	232,277.15	
	CAPITALAND CHINA TRUST	113,900.00	134,402.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	575,408.00	1,334,946.56	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	94,950.00	124,384.50	
	EC WORLD REIT	52,800.00	34,056.00	
	ESR-REIT	606,713.00	254,819.46	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	99,600.00	66,234.00	
	FIRST REAL ESTATE INV T TRUST	176,400.00	54,684.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	141,800.00	343,156.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC I	309,638.00	452,071.48	
	IREIT GLOBAL	57,600.00	36,576.00	
	KEPPEL DC REIT	143,600.00	301,560.00	
	KEPPEL REIT	202,900.00	245,509.00	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	175,700.00	136,167.50	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	261,800.00	500,038.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	217,000.00	577,220.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	380,350.00	684,630.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	235,000.00	289,050.00	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	243,200.00	102,144.00	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	39,600.00	196,416.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	66,700.00	55,694.50	
SPH REIT	115,700.00	111,650.50		
STARHILL GLOBAL REIT	138,200.00	82,229.00		
SUNTEC REIT	239,900.00	439,017.00		
	シンガポール・ドル小計	5,298,114.00	7,889,889.65 (733,444,142)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	83,275.00	111,588.50	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	123,606.00	284,293.80	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	182,643.00	198,167.65	

	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	151,115.00	232,717.10	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	46,161.00	144,022.32	
	ニュージーランド・ドル小計	586,800.00	970,789.37 (82,089,949)	
イギリス・ポンド	AEW UK REIT PLC	9,000.00	11,700.00	
	ASSURA PLC	320,833.00	211,428.94	
	BIG YELLOW GROUP PLC	20,546.00	306,751.78	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	89,651.00	103,098.65	
	BRITISH LAND CO PLC	107,908.00	546,877.74	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	95,185.00	149,821.19	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	52,238.00	45,081.39	
	CUSTODIAN REIT PLC	39,999.00	40,398.99	
	DERWENT LONDON PLC	12,339.00	383,742.90	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	60,037.00	54,213.41	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	30,485.00	211,413.47	
	HAMMERSON PLC	440,241.00	127,229.64	
	HOME REIT PLC	65,147.00	81,173.16	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	41,816.00	51,851.84	
	INTU PROPERTIES PLC	28,500.00	285.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	81,923.00	617,371.72	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	118,804.00	324,810.13	
	LXI REIT PLC	112,143.00	167,765.92	
	NEWRIVER REIT PLC	46,021.00	42,155.23	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	57,141.00	56,112.46	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	146,583.00	215,183.84	
	PRS REIT PLC/THE	41,845.00	45,192.60	
	REGIONAL REIT LTD	45,664.00	39,590.68	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	25,924.00	337,530.48	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	70,698.00	41,075.53	
	SEGRO PLC	135,135.00	1,841,214.37	
	SHAFTESBURY PLC	36,339.00	217,307.22	
	STANDARD LIFE INV PROP INC	53,280.00	44,755.20	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	109,811.00	135,616.58	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	34,770.00	30,632.37	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	208,155.00	510,812.37		
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	117,847.00	105,237.37		

	UNITE GROUP PLC/THE	43,620.00	497,268.00	
	WORKSPACE GROUP PLC	13,356.00	87,281.46	
	イギリス・ポンド小計	2,912,984.00	7,681,981.63 (1,249,397,492)	
イスラエル・シュケル	REIT 1 LTD	20,136.00	437,152.56	
	イスラエル・シュケル小計	20,136.00	437,152.56 (16,984,515)	
韓国・ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	14,308.00	103,733,000.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	4,067.00	24,971,380.00	
	JR REIT XXVII	12,767.00	74,303,940.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	6,226.00	45,449,800.00	
	LOTTE REIT CO LTD	12,522.00	75,132,000.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	9,815.00	49,075,000.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	5,302.00	42,734,120.00	
	SK REITS CO LTD	12,831.00	89,817,000.00	
	韓国・ウォン小計	77,838.00	505,216,240.00 (51,683,621)	
ユーロ	AEDIFICA	4,152.00	474,573.60	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	1,480.00	20,586.80	
	ALTAREA	506.00	75,495.20	
	BEFIMMO	2,652.00	125,970.00	
	CARE PROPERTY INVEST	3,490.00	85,156.00	
	CARMILA	4,754.00	73,972.24	
	COFINIMMO	3,285.00	434,277.00	
	COIMA RES SPA	3,144.00	25,183.44	
	COVIVIO	5,703.00	392,366.40	
	CROMWELL REIT EUR	48,320.00	110,169.60	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	4,778.00	116,487.64	
	GECINA SA	6,030.00	662,094.00	
	HAMBORNER REIT AG	8,022.00	77,973.84	
	HIBERNIA REIT PLC	77,486.00	125,527.32	
	ICADE	3,844.00	227,949.20	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	4,798.00	21,854.89	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	29,903.00	242,513.33	
INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	2,388.00	67,938.60		
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	45,608.00	67,499.84		

	KLEPIERRE	20,731.00	475,569.14	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	6,940.00	35,949.20	
	MERCIALYS	6,257.00	57,783.39	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	36,919.00	399,463.58	
	MONTEA NV	989.00	113,339.40	
	NSI NV	2,336.00	86,548.80	
	RETAIL ESTATES	1,586.00	116,253.80	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	13,143.00	922,244.31	
	VASTNED RETAIL NV	2,035.00	50,671.50	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	16,051.00	617,963.50	
	WERELDHAVE NV	3,950.00	68,137.50	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	2,441.00	123,514.60	
	ユーロ小計	373,721.00	6,495,027.66 (889,039,386)	
投資証券合計			23,371,768,716 (23,371,768,716)	
合 計			23,371,768,716 (23,371,768,716)	

(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 153銘柄	75.9%	77.2%
カナダ・ドル	投資証券 30銘柄	1.8%	1.9%
オーストラリア・ドル	投資証券 32銘柄	6.5%	6.6%
香港・ドル	投資証券 6銘柄	1.3%	1.4%
シンガポール・ドル	投資証券 26銘柄	3.1%	3.1%
ニュージーランド・ドル	投資証券 5銘柄	0.3%	0.4%
イギリス・ポンド	投資証券 34銘柄	5.3%	5.3%
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	0.1%	0.1%
韓国・ウォン	投資証券 8銘柄	0.2%	0.2%
ユーロ	投資証券 31銘柄	3.7%	3.8%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

## 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26日現在)	(2022年4月26日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	115,436,377	8,823,285

コール・ローン	264,898,208	445,040,057
国債証券	105,830,132,390	108,663,423,560
地方債証券	8,548,198,020	9,869,641,000
特殊債券	11,590,909,198	9,355,166,234
社債券	4,049,851,000	5,077,580,900
未収入金	147,505,200	-
未収利息	272,216,894	244,695,528
前払費用	3,189,756	3,832,499
流動資産合計	130,822,337,043	133,668,203,063
資産合計	130,822,337,043	133,668,203,063
負債の部		
流動負債		
未払解約金	121,292,855	240,908
未払利息	766	-
その他未払費用	12,631	1,265
流動負債合計	121,306,252	242,173
負債合計	121,306,252	242,173
純資産の部		
元本等		
元本	102,129,036,469	106,516,151,054
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	28,571,994,322	27,151,809,836
元本等合計	130,701,030,791	133,667,960,890
純資産合計	130,701,030,791	133,667,960,890
負債純資産合計	130,822,337,043	133,668,203,063

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年4月27日 至 2022年4月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年4月26日現在)	(2022年4月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	102,129,036,469口	106,516,151,054口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2798円 (1万口当たりの純資産額12,798円)	1口当たり純資産額 1.2549円 (1万口当たりの純資産額12,549円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年4月27日 至 2022年4月26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年4月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>



## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

自 2021年4月27日 至 2022年4月26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26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	105,756,496,620円
同期中における追加設定元本額	20,315,447,294円
同期中における一部解約元本額	23,942,907,445円
2021年4月26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)	6,095,887,942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)	700,095,955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)	184,825,933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)	433,396,306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)	578,861,248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)	261,394,053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)	405,524,676円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	136,367,739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)	1,247,380,644円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	401,741,595円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	588,869,057円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	120,192,626円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	34,443,552円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	93,363,201円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	77,139,001円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	128,231,732円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	35,509,835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>	1,590,676,701円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	14,416,480,636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>	291,860,981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>	124,997,220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>	2,221,232,701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>	9,293,268,718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)	1,258,717,162円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	469,800,479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>	182,525,240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>	1,623,185,800円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,259,171,883円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	791,362,877円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	219,084,514円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	19,227,758円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	298,258,456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<適格機関投資家限定>	3,349,108,014円
合計	102,129,036,469円

(2022年4月26日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	102,129,036,469円
同期中における追加設定元本額	21,666,315,900円
同期中における一部解約元本額	17,279,201,315円
2022年4月26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)	6,923,178,718円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	11,786,209,165円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,712,289,325円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	840,055,482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)	44,220,066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)	776,225,280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)	393,791,215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)	525,712,133円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	140,007,655円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	2,027,250,671円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,067,412,920円

アセットアロケーション・ファンド(成長型)	428,125,024円
三井住友D S ・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)	2,013,005,035円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	679,976,897円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	1,079,337,052円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	252,769,138円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	93,799,630円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	160,655,525円
三井住友D S ・年金バランス30(債券重点型)	125,827,246円
三井住友D S ・年金バランス50(標準型)	232,432,159円
三井住友D S ・年金バランス70(株式重点型)	73,539,762円
三井住友D S ・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>	1,414,908,868円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	12,052,710,188円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	6,250,509,723円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	15,736,258,422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>	2,172,295,327円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,383,496,689円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	8,382,272,785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)	1,157,953,402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>	1,435,609,974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>	682,051,884円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	209,544,800円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	19,574,044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>	5,119,360,113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<適格機関投資家限定>	5,928,068,863円
合計	106,516,151,054円

## ( 3 ) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

( 単位 : 円 )

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	4 3 1 2 年国債	50,000,000	50,063,500	
	4 3 2 2 年国債	750,000,000	750,945,000	
	4 3 3 2 年国債	330,000,000	330,405,900	
	4 3 4 2 年国債	1,130,000,000	1,131,457,700	
	4 3 5 2 年国債	3,480,000,000	3,484,350,000	
	1 3 8 5 年国債	600,000,000	601,680,000	
	1 3 9 5 年国債	260,000,000	260,787,800	
	1 4 0 5 年国債	600,000,000	601,932,000	
	1 4 1 5 年国債	795,000,000	797,766,600	
	1 4 2 5 年国債	760,000,000	763,017,200	
	1 4 3 5 年国債	770,000,000	773,234,000	
	1 4 4 5 年国債	980,000,000	984,321,800	
	1 4 5 5 年国債	1,080,000,000	1,084,957,200	
	1 4 6 5 年国債	1,550,000,000	1,557,347,000	
	1 4 7 5 年国債	1,540,000,000	1,541,786,400	
	1 4 8 5 年国債	1,070,000,000	1,071,102,100	
	1 4 9 5 年国債	1,240,000,000	1,240,818,400	
	1 5 0 5 年国債	2,510,000,000	2,511,154,600	
	1 4 0 年国債	40,000,000	53,671,200	
	2 4 0 年国債	242,000,000	314,549,180	
	3 4 0 年国債	185,000,000	241,861,600	
	4 4 0 年国債	247,000,000	323,229,140	
	5 4 0 年国債	235,000,000	296,593,500	
	6 4 0 年国債	240,000,000	298,015,200	
	7 4 0 年国債	285,000,000	339,816,900	
	8 4 0 年国債	300,000,000	333,834,000	
	9 4 0 年国債	513,000,000	424,333,080	
	1 0 4 0 年国債	450,000,000	436,099,500	
	1 1 4 0 年国債	380,000,000	356,158,800	
	1 2 4 0 年国債	380,000,000	320,161,400	
	1 3 4 0 年国債	475,000,000	398,235,250	
	1 4 4 0 年国債	475,000,000	425,557,250	
	3 3 2 1 0 年国債	793,000,000	801,770,580	
	3 3 3 1 0 年国債	815,000,000	825,203,800	
	3 3 4 1 0 年国債	315,000,000	319,400,550	
	3 3 5 1 0 年国債	90,000,000	91,178,100	
	3 3 6 1 0 年国債	340,000,000	344,960,600	
	3 3 7 1 0 年国債	120,000,000	121,113,600	
3 3 8 1 0 年国債	805,000,000	815,384,500		

339	10年国債	785,000,000	795,880,100	
340	10年国債	770,000,000	781,396,000	
341	10年国債	557,000,000	563,711,850	
342	10年国債	350,000,000	351,704,500	
343	10年国債	310,000,000	311,543,800	
344	10年国債	811,000,000	814,925,240	
345	10年国債	258,000,000	259,259,040	
346	10年国債	540,000,000	542,376,000	
347	10年国債	680,000,000	682,618,000	
348	10年国債	625,000,000	627,018,750	
349	10年国債	610,000,000	611,714,100	
350	10年国債	590,000,000	591,038,400	
351	10年国債	390,000,000	390,354,900	
352	10年国債	570,000,000	570,000,000	
353	10年国債	520,000,000	519,485,200	
354	10年国債	435,000,000	434,103,900	
355	10年国債	700,000,000	697,522,000	
356	10年国債	940,000,000	935,525,600	
357	10年国債	910,000,000	904,503,600	
358	10年国債	1,130,000,000	1,122,078,700	
359	10年国債	1,210,000,000	1,200,295,800	
360	10年国債	1,120,000,000	1,109,830,400	
361	10年国債	1,310,000,000	1,296,651,100	
362	10年国債	1,150,000,000	1,136,959,000	
363	10年国債	800,000,000	790,328,000	
364	10年国債	950,000,000	937,336,500	
365	10年国債	1,060,000,000	1,045,011,600	
366	10年国債	370,000,000	368,390,500	
2	30年国債	510,000,000	597,760,800	
4	30年国債	340,000,000	417,496,200	
5	30年国債	290,000,000	341,173,400	
7	30年国債	474,000,000	569,657,940	
9	30年国債	240,000,000	267,381,600	
10	30年国債	465,000,000	503,715,900	
11	30年国債	430,000,000	494,138,800	
12	30年国債	570,000,000	681,218,400	
14	30年国債	622,000,000	768,493,440	
16	30年国債	465,000,000	583,119,300	
18	30年国債	540,000,000	667,045,800	
19	30年国債	470,000,000	581,907,000	
21	30年国債	345,000,000	429,004,050	
22	30年国債	315,000,000	401,023,350	
23	30年国債	329,000,000	419,823,740	
24	30年国債	310,000,000	396,477,600	
25	30年国債	290,000,000	363,483,100	

26	30年国債	363,000,000	460,850,280	
27	30年国債	420,000,000	541,270,800	
28	30年国債	386,000,000	498,943,600	
29	30年国債	177,000,000	226,768,860	
30	30年国債	442,000,000	560,707,940	
31	30年国債	325,000,000	407,566,250	
32	30年国債	360,000,000	458,161,200	
33	30年国債	368,000,000	450,384,160	
34	30年国債	457,000,000	575,719,460	
35	30年国債	350,000,000	429,548,000	
36	30年国債	90,000,000	110,529,000	
37	30年国債	435,000,000	526,767,600	
38	30年国債	410,000,000	489,093,100	
39	30年国債	180,000,000	218,379,600	
40	30年国債	270,000,000	322,574,400	
41	30年国債	270,000,000	317,476,800	
42	30年国債	280,000,000	329,406,000	
43	30年国債	285,000,000	335,467,800	
44	30年国債	280,000,000	329,747,600	
45	30年国債	355,000,000	403,422,000	
46	30年国債	315,000,000	358,013,250	
47	30年国債	330,000,000	381,932,100	
48	30年国債	335,000,000	373,880,100	
49	30年国債	315,000,000	351,536,850	
50	30年国債	295,000,000	290,914,250	
51	30年国債	315,000,000	276,138,450	
52	30年国債	343,000,000	314,918,590	
53	30年国債	307,000,000	288,128,710	
54	30年国債	75,000,000	73,548,750	
55	30年国債	325,000,000	318,334,250	
56	30年国債	500,000,000	489,155,000	
57	30年国債	355,000,000	346,519,050	
58	30年国債	340,000,000	331,119,200	
59	30年国債	360,000,000	341,506,800	
60	30年国債	350,000,000	347,774,000	
61	30年国債	345,000,000	325,962,900	
62	30年国債	165,000,000	147,826,800	
63	30年国債	320,000,000	278,409,600	
64	30年国債	305,000,000	264,502,100	
65	30年国債	305,000,000	264,215,400	
66	30年国債	310,000,000	268,549,900	
67	30年国債	350,000,000	319,245,500	
68	30年国債	350,000,000	318,678,500	
69	30年国債	440,000,000	411,061,200	
70	30年国債	350,000,000	326,095,000	

7 1	3 0 年国債	320,000,000	297,996,800	
7 2	3 0 年国債	380,000,000	353,293,600	
7 3	3 0 年国債	410,000,000	380,996,600	
7 4	3 0 年国債	10,000,000	10,034,600	
6 5	2 0 年国債	1,020,000,000	1,053,170,400	
6 9	2 0 年国債	1,020,000,000	1,061,809,800	
7 0	2 0 年国債	780,000,000	821,090,400	
7 2	2 0 年国債	753,000,000	791,802,090	
7 4	2 0 年国債	664,000,000	701,867,920	
7 5	2 0 年国債	490,000,000	520,473,100	
7 8	2 0 年国債	590,000,000	626,072,600	
8 2	2 0 年国債	620,000,000	665,055,400	
8 4	2 0 年国債	500,000,000	537,080,000	
8 5	2 0 年国債	645,000,000	698,444,700	
8 8	2 0 年国債	742,000,000	813,462,020	
8 9	2 0 年国債	20,000,000	21,843,200	
9 0	2 0 年国債	580,000,000	636,422,400	
9 2	2 0 年国債	424,000,000	465,505,360	
9 3	2 0 年国債	632,000,000	693,544,160	
9 5	2 0 年国債	305,000,000	340,672,800	
9 7	2 0 年国債	677,000,000	755,789,260	
9 9	2 0 年国債	153,000,000	170,715,870	
1 0 0	2 0 年国債	207,000,000	232,955,730	
1 0 1	2 0 年国債	355,000,000	403,684,700	
1 0 2	2 0 年国債	457,000,000	521,862,010	
1 0 5	2 0 年国債	390,000,000	439,740,600	
1 0 6	2 0 年国債	370,000,000	419,543,000	
1 0 7	2 0 年国債	378,000,000	427,654,080	
1 0 8	2 0 年国債	390,000,000	436,078,500	
1 0 9	2 0 年国債	140,000,000	156,989,000	
1 1 1	2 0 年国債	386,000,000	442,271,080	
1 1 3	2 0 年国債	227,000,000	259,299,830	
1 1 4	2 0 年国債	263,000,000	301,326,990	
1 1 6	2 0 年国債	100,000,000	115,771,000	
1 1 8	2 0 年国債	200,000,000	229,044,000	
1 1 9	2 0 年国債	295,000,000	333,108,100	
1 2 0	2 0 年国債	200,000,000	222,626,000	
1 2 1	2 0 年国債	55,000,000	62,750,050	
1 2 2	2 0 年国債	330,000,000	373,771,200	
1 2 3	2 0 年国債	80,000,000	92,883,200	
1 2 4	2 0 年国債	190,000,000	218,984,500	
1 2 5	2 0 年国債	205,000,000	240,518,300	
1 2 6	2 0 年国債	180,000,000	208,045,800	
1 2 7	2 0 年国債	145,000,000	166,326,600	
1 2 8	2 0 年国債	65,000,000	74,792,250	

130	20年国債	155,000,000	177,389,750	
131	20年国債	380,000,000	431,395,000	
132	20年国債	450,000,000	512,199,000	
133	20年国債	190,000,000	218,055,400	
134	20年国債	200,000,000	230,158,000	
135	20年国債	155,000,000	176,873,600	
136	20年国債	120,000,000	135,775,200	
137	20年国債	185,000,000	211,338,450	
139	20年国債	60,000,000	67,948,800	
140	20年国債	340,000,000	388,983,800	
142	20年国債	190,000,000	219,636,200	
143	20年国債	120,000,000	136,387,200	
144	20年国債	170,000,000	191,421,700	
145	20年国債	110,000,000	126,407,600	
146	20年国債	95,000,000	109,298,450	
147	20年国債	210,000,000	239,515,500	
148	20年国債	219,000,000	247,618,920	
149	20年国債	575,000,000	650,911,500	
150	20年国債	391,000,000	438,224,980	
151	20年国債	580,000,000	636,248,400	
152	20年国債	585,000,000	641,996,550	
153	20年国債	437,000,000	485,214,210	
154	20年国債	380,000,000	417,069,000	
155	20年国債	410,000,000	439,278,100	
156	20年国債	480,000,000	475,612,800	
157	20年国債	335,000,000	322,146,050	
158	20年国債	410,000,000	410,549,400	
159	20年国債	388,000,000	393,292,320	
160	20年国債	355,000,000	364,336,500	
161	20年国債	380,000,000	383,997,600	
162	20年国債	370,000,000	373,156,100	
163	20年国債	430,000,000	432,782,100	
164	20年国債	385,000,000	380,791,950	
165	20年国債	390,000,000	384,824,700	
166	20年国債	335,000,000	340,252,800	
167	20年国債	400,000,000	393,052,000	
168	20年国債	480,000,000	462,787,200	
169	20年国債	400,000,000	378,108,000	
170	20年国債	385,000,000	362,800,900	
171	20年国債	365,000,000	342,870,050	
172	20年国債	480,000,000	457,459,200	
173	20年国債	505,000,000	480,214,600	
174	20年国債	510,000,000	483,480,000	
175	20年国債	515,000,000	495,960,450	
176	20年国債	610,000,000	585,728,100	



	177 20年国債	540,000,000	507,929,400	
	178 20年国債	500,000,000	478,020,000	
	179 20年国債	580,000,000	553,267,800	
	国債証券 小計		108,663,423,560	
地方債証券	727 東京都公債	500,000,000	505,446,000	
	792 東京都公債	300,000,000	295,790,100	
	1 東京都30年	100,000,000	119,537,800	
	8 東京都30年	400,000,000	498,271,200	
	13 東京都30年	500,000,000	604,446,000	
	1 東京都20年	100,000,000	101,722,800	
	6 東京都20年	100,000,000	105,550,000	
	24-14 北海道公債	100,000,000	100,648,700	
	26-15 北海道公債	100,000,000	100,979,900	
	30-18 北海道公債	200,000,000	198,184,200	
	1 神奈川県20年	100,000,000	105,294,000	
	3 神奈川県20年	100,000,000	106,356,400	
	7 神奈川県20年	100,000,000	110,258,800	
	13 神奈川県20年	100,000,000	114,398,600	
	373 大阪府公債	100,000,000	100,995,200	
	377 大阪府公債	100,000,000	101,018,400	
	388 大阪府公債	100,000,000	101,091,400	
	27-4 京都府公債	100,000,000	101,450,100	
	29-12 京都府5年	300,000,000	300,031,800	
	1-6 京都府5年	200,000,000	199,606,600	
	5 兵庫県公債15年	300,000,000	319,867,800	
	10 兵庫県公債20年	100,000,000	114,659,600	
	7 静岡県30年	100,000,000	122,100,600	
	1 静岡県20年	100,000,000	107,094,800	
	22-8 愛知県20年	200,000,000	225,911,000	
	27-16 愛知県公債	400,000,000	405,204,000	
	25-11 福岡県公債	100,000,000	101,140,000	
	26-3 福岡県公債	100,000,000	101,109,200	
	26-10 福岡県公債	100,000,000	101,049,700	
	1-1 福岡県公債	200,000,000	196,451,800	
	25-8 千葉県公債	100,000,000	100,969,700	
	118 共同発行地方	100,000,000	100,607,900	
	137 共同発行地方	200,000,000	202,235,000	
	138 共同発行地方	200,000,000	202,260,400	
	172 共同発行地方	500,000,000	502,127,500	
	183 共同発行地方	600,000,000	600,065,400	
	1-1 大阪市5年	300,000,000	299,553,900	
	1 名古屋市20年	200,000,000	206,370,600	
	3 名古屋市20年	100,000,000	106,105,000	
	5 名古屋市20年	100,000,000	109,617,200	
	29-5 京都市5年	100,000,000	100,009,900	

	1 京都市30年	100,000,000	128,853,400	
	7 京都市20年	100,000,000	113,701,000	
	26-17 神戸市公債	100,000,000	100,547,500	
	26-3 横浜市公債	200,000,000	202,256,000	
	4 横浜市20年	100,000,000	105,630,500	
	9 横浜市20年	100,000,000	109,294,300	
	14 横浜市20年	100,000,000	112,486,300	
	47 横浜市5年	100,000,000	100,010,500	
	26-4 札幌市公債	100,000,000	100,978,900	
	24-2 北九州市債	100,000,000	100,458,400	
	1-2 北九州市5年	100,000,000	99,803,400	
	29-11 福岡市5年	300,000,000	300,031,800	
	地方債証券 小計		9,869,641,000	
特殊債券	3 政保政策投資CO	200,000,000	206,966,600	
	36 日本政策投資B	100,000,000	110,548,500	
	18 道路機構	100,000,000	141,245,900	
	22 道路機構	300,000,000	410,631,300	
	27 道路機構	100,000,000	111,755,900	
	37 道路機構	300,000,000	339,990,600	
	47 道路機構	200,000,000	228,975,400	
	104 道路機構	400,000,000	402,432,400	
	79 政保道路機構	200,000,000	226,602,600	
	81 政保道路機構	200,000,000	226,841,000	
	88 政保道路機構	100,000,000	126,411,200	
	90 政保道路機構	500,000,000	569,185,500	
	99 政保道路機構	100,000,000	115,088,000	
	176 政保道路機構	100,000,000	113,400,600	
	196 政保道路機構	100,000,000	115,213,800	
	210 政保道路機構	200,000,000	225,983,400	
	227 政保道路機構	200,000,000	202,641,000	
	231 政保道路機構	300,000,000	303,845,700	
	288 政保道路機構	189,000,000	188,745,039	
	9 道路債券	100,000,000	125,199,500	
	2 地方公営20年	100,000,000	113,797,000	
	45 地方公共団体	200,000,000	201,277,200	
	61 地方公共団体	100,000,000	101,319,400	
	62 地方公共団体	400,000,000	404,938,400	
	63 地方公共団体	100,000,000	101,169,300	
	67 政保地方公共団	100,000,000	101,219,700	
	101 地方公共団体	100,000,000	100,332,700	
	106 地方公共団体	200,000,000	200,074,800	
	3 公営企業20年	100,000,000	100,897,400	
	5 公営企業20年	100,000,000	102,894,800	
	17 公営企業20年	100,000,000	108,925,300	
	20 公営企業20年	100,000,000	110,357,300	

2 2	公営企業2 0年	100,000,000	111,097,700	
2 4	公営企業2 0年	200,000,000	224,716,800	
5 2	住宅支援機構	100,000,000	113,502,400	
1 3 0	住宅支援機構	200,000,000	228,153,800	
2 2 6	住宅支援機構	100,000,000	100,251,500	
S 9	住宅金融R M B S	20,640,000	20,817,504	
S 1 0	住宅金融R M B S	31,836,000	32,087,504	
S 3	住宅機構R M B S	11,144,000	11,317,846	
S 5	住宅機構R M B S	23,666,000	24,170,085	
S 7	住宅機構R M B S	12,205,000	12,461,305	
S 9	住宅機構R M B S	12,367,000	12,712,039	
S 1 0	住宅機構R M B S	12,197,000	12,473,871	
S 1 1	住宅機構R M B S	13,073,000	13,488,721	
2 9	住宅金融R M B S	10,032,000	10,096,204	
3 2	住宅金融R M B S	11,073,000	11,201,446	
3 5	住宅金融R M B S	11,822,000	12,045,435	
3 9	住宅金融R M B S	10,766,000	10,907,034	
4 1	住宅金融R M B S	11,525,000	11,780,855	
4 3	住宅金融R M B S	22,070,000	22,454,018	
5 1	住宅金融R M B S	10,506,000	10,590,048	
5 3	住宅金融R M B S	11,419,000	11,632,535	
1	住宅機構R M B S	20,726,000	20,889,735	
2	住宅機構R M B S	23,390,000	23,963,055	
4	住宅機構R M B S	10,780,000	10,967,572	
6	住宅機構R M B S	10,721,000	10,891,463	
1 9	住宅機構R M B S	15,880,000	16,648,592	
2 4	住宅機構R M B S	32,450,000	34,228,260	
2 6	住宅機構R M B S	50,523,000	53,155,248	
2 7	住宅機構R M B S	18,258,000	19,234,803	
2 8	住宅機構R M B S	20,026,000	21,201,526	
2 9	住宅機構R M B S	22,104,000	23,474,448	
3 0	住宅機構R M B S	22,033,000	23,414,469	
3 2	住宅機構R M B S	43,162,000	45,527,277	
3 5	住宅機構R M B S	21,904,000	23,132,814	
3 6	住宅機構R M B S	21,275,000	22,402,575	
4 3	住宅機構R M B S	26,914,000	28,348,516	
4 6	住宅機構R M B S	21,342,000	22,483,797	
4 8	住宅機構R M B S	40,284,000	42,354,597	
4 9	住宅機構R M B S	20,570,000	21,540,904	
5 1	住宅機構R M B S	45,364,000	47,477,962	
5 5	住宅機構R M B S	60,218,000	62,849,526	
5 7	住宅機構R M B S	29,469,000	30,747,954	
5 8	住宅機構R M B S	33,387,000	34,846,011	
5 9	住宅機構R M B S	64,350,000	67,200,705	
6 0	住宅機構R M B S	101,619,000	105,673,598	

	6 1 住宅機構R M B S	33,618,000	34,952,634	
	6 7 住宅機構R M B S	39,831,000	41,081,693	
	6 9 住宅機構R M B S	81,038,000	84,303,831	
	7 0 住宅機構R M B S	70,776,000	73,451,332	
	7 3 住宅機構R M B S	40,325,000	41,990,422	
	9 9 住宅機構R M B S	60,688,000	61,901,760	
	1 2 3 住宅機構R M B S	78,771,000	77,920,273	
	1 2 4 住宅機構R M B S	78,620,000	77,542,906	
	1 2 5 住宅機構R M B S	78,727,000	77,648,440	
	1 2 7 住宅機構R M B S	80,432,000	79,145,088	
	1 2 8 住宅機構R M B S	79,545,000	78,399,552	
	1 2 9 住宅機構R M B S	81,229,000	80,246,129	
	1 3 7 住宅機構R M B S	84,072,000	82,937,028	
	1 6 7 住宅機構R M B S	96,274,000	94,569,950	
	8 5 中日本高速道	300,000,000	299,553,900	
	特殊債券 小計		9,355,166,234	
社債券	2 BPCE S.A.	200,000,000	200,534,400	
	2 0 西日本高速道	100,000,000	100,998,000	
	2 3 西日本高速道	100,000,000	101,099,000	
	1 3 大和ハウス	100,000,000	100,232,200	
	3 0 東レ	100,000,000	100,444,900	
	5 6 住友化学	200,000,000	200,600,000	
	2 4 三菱ケミカルホールデイ	100,000,000	100,211,800	
	1 6 日立製作所	100,000,000	101,208,500	
	2 2 パナソニック	100,000,000	99,711,100	
	9 T D K	100,000,000	98,303,300	
	6 3 三井物産	100,000,000	110,518,600	
	8 みずほコーポレート	100,000,000	111,260,500	
	1 三井住友F G劣後	100,000,000	101,110,100	
	8 住友信託 劣後	100,000,000	109,932,800	
	1 みずほF G劣後	100,000,000	100,991,900	
	9 みずほ銀行劣後	100,000,000	109,458,200	
	1 7 N T Tファイナンス	200,000,000	199,622,200	
	7 3 ホンダファイナンス	200,000,000	198,949,000	
	2 三菱H Cキャピタル	200,000,000	198,550,600	
	1 野村ホールディングス	100,000,000	99,969,500	
	5 8 三菱地所	100,000,000	123,429,600	
	1 3 5 三菱地所	200,000,000	195,868,200	
	1 0 東急	100,000,000	97,844,800	
	3 8 京王電鉄	100,000,000	100,215,100	
	1 1 0 東日本旅客鉄	100,000,000	115,115,800	
	1 6 9 東日本旅客鉄	200,000,000	195,052,800	
	4 1 東海旅客鉄道	100,000,000	112,174,500	
	4 2 東海旅客鉄道	100,000,000	113,488,300	
	4 5 東京地下鉄	100,000,000	98,353,100	

6 4	阪急阪神H L D G	100,000,000	99,502,600	
5 4 6	中部電力	200,000,000	194,541,800	
5 5 3	中部電力	200,000,000	199,639,400	
5 0 8	東北電力	200,000,000	199,810,400	
4 9 6	九州電力	300,000,000	291,747,900	
3 8	東京電力パワー	100,000,000	100,366,300	
4 1	大阪瓦斯	200,000,000	196,146,600	
7	ファーストリテイリング	100,000,000	100,577,100	
	社債券 小計		5,077,580,900	
	合 計		132,965,811,694	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

## ( 1 ) 貸借対照表

( 単位 : 円 )

	( 2021年4月26日現在 )	( 2022年4月26日現在 )
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	101,589,326	211,176,152
金銭信託	105,268,890	5,445,859
コール・ローン	241,566,316	274,685,132
国債証券	161,434,643,407	154,868,895,807
派生商品評価勘定	1,325,008	141,836
未収入金	653,000,000	-
未収利息	1,174,280,811	1,049,674,843
前払費用	20,257,638	52,885,106
流動資産合計	163,731,931,396	156,462,904,735
資産合計	163,731,931,396	156,462,904,735
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	489,197	-
未払金	647,205,081	-
未払解約金	265,826,302	165,954,422
未払利息	699	-
その他未払費用	9,108	859
流動負債合計	913,530,387	165,955,281
負債合計	913,530,387	165,955,281
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	84,390,597,281	78,572,267,228
剰余金		
剰余金又は欠損金 ( )	78,427,803,728	77,724,682,226
元本等合計	162,818,401,009	156,296,949,454
純資産合計	162,818,401,009	156,296,949,454

負債純資産合計

163,731,931,396

156,462,904,735

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年4月27日 至 2022年4月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年4月26日現在)	(2022年4月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	84,390,597,281口	78,572,267,228口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.9293円 (1万口当たりの純資産額19,293円)	1口当たり純資産額 1.9892円 (1万口当たりの純資産額19,892円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年4月27日 至 2022年4月26日

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

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年4月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	309,432,427	-	309,153,111	279,316
	イギリス・ポンド	49,432,655	-	49,222,779	209,876
	スウェーデン・クローナ	26,903,934	-	26,965,931	61,997
	ユーロ	264,273,378	-	265,536,384	1,263,006
	小計	650,042,394	-	650,878,205	835,811
合計		650,042,394	-	650,878,205	835,811

(2022年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		



市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	235,598,096	-	235,544,702	53,394
	イギリス・ポンド	32,575,418	-	32,566,006	9,412
	メキシコ・ペソ	30,682,438	-	30,670,282	12,156
	ユーロ	194,426,170	-	194,359,296	66,874
	小計	493,282,122	-	493,140,286	141,836
合 計		493,282,122	-	493,140,286	141,836

## (注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

自 2021年4月27日 至 2022年4月26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26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	84,222,011,513円
同期中における追加設定元本額	11,191,601,392円
同期中における一部解約元本額	11,023,015,624円
2021年4月26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	23,534,936,984円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	729,649,813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
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	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)	28,769,951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)	94,042,578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)	114,062,243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)	24,082,222円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	139,530,302円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	165,360,909円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	88,010,634円
イオン・バランス戦略ファンド	82,884,377円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	13,098,149円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	70,276,236円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	46,159,136円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	110,380,542円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	33,794,045円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	22,772,725円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	82,278,579円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	123,896,191円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	9,281,514円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	24,027,031円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	15,516,979円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	1,832,778円
S M A M・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	2,338,391,074円
S M A M・バランスファンドV A安定成長型<適格機関投資家限定>	53,057,364円
S M A M・バランスファンドV A 2 5<適格機関投資家専用>	8,328,869,926円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用>	4,860,208,256円
S M A M・バランスファンドV A 5 0<適格機関投資家専用>	11,174,840,543円
S M A M・バランスファンドV L 3 0<適格機関投資家限定>	35,901,694円
S M A M・バランスファンドV L 5 0<適格機関投資家限定>	97,373,210円
S M A M・バランスファンドV A 7 5<適格機関投資家専用>	740,287,615円
S M A M・バランスファンドV L国際分散型<適格機関投資家限定>	121,217,577円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5<適格機関投資家専用>	1,100,173,191円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0<適格機関投資家専用>	1,455,394,432円
S M A M・バランスファンドV A 4 0<適格機関投資家専用>	1,680,280,937円
S M A M・バランスファンドV A 3 5<適格機関投資家専用>	5,267,062,313円
S M A M・バランスV A株4 0 T<適格機関投資家限定>	619,895円
S M A M・外国債券パッシブファンドV A<適格機関投資家限定>	8,780,087,672円
三井住友・外国債券インデックスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	345,222,445円
S M A M・グローバルバランス4 0 V A<適格機関投資家限定>	154,703,653円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A<適格機関投資家専用>	90,561,097円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A<適格機関投資家専用>	35,408,120円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A<適格機関投資家専用>	11,874,819円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 L<適格機関投資家専用>	108,523,473円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L<適格機関投資家専用>	453,166,105円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A 2<適格機関投資家専用>	119,259,614円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A 2<適格機関投資家専用>	42,530,817円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A 2<適格機関投資家専用>	5,288,637円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L 2<適格機関投資家専用>	1,117,376,981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>	715,810,156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>	1,078,469,323円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	3,029,032,100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・ファンド<適格機関投資家限定>	47,517,572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<適格機関投資家限定>	956,808,220円
合計	84,390,597,281円

(2022年4月26日現在)

## 開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	84,390,597,281円
同期中における追加設定元本額	10,759,091,011円
同期中における一部解約元本額	16,577,421,064円

## 2022年4月26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	24,404,431,209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)	117,929,040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)	28,777,610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)	93,657,355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)	23,180,349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	301,813,312円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	14,359,695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)	226,959,316円

三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド	4,226,574円
S M A M・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	3,835,643,626円
S M A M・バランスファンドV A安定成長型<適格機関投資家限定>	40,032,740円
S M A M・バランスファンドV A 2 5<適格機関投資家専用>	6,760,871,438円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用>	4,399,167,424円
S M A M・バランスファンドV A 5 0<適格機関投資家専用>	10,143,367,252円
S M A M・バランスファンドV L 3 0<適格機関投資家限定>	34,375,893円
S M A M・バランスファンドV L 5 0<適格機関投資家限定>	87,983,369円
S M A M・バランスファンドV A 7 5<適格機関投資家専用>	690,283,030円
S M A M・バランスファンドV L国際分散型<適格機関投資家限定>	117,223,907円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5<適格機関投資家専用>	1,014,133,750円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0<適格機関投資家専用>	1,376,833,275円
S M A M・バランスファンドV A 4 0<適格機関投資家専用>	1,520,894,654円
S M A M・バランスファンドV A 3 5<適格機関投資家専用>	4,660,449,956円
S M A M・バランスV A株4 0 T<適格機関投資家限定>	627,347円
S M A M・外国債券パッシブファンドV A<適格機関投資家限定>	7,806,718,281円
三井住友・外国債券インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	319,831,085円
S M A M・グローバルバランス4 0 V A<適格機関投資家限定>	140,778,313円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A<適格機関投資家専用>	78,444,198円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A<適格機関投資家専用>	33,971,193円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A<適格機関投資家専用>	11,926,289円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 L<適格機関投資家専用>	95,205,741円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L<適格機関投資家専用>	404,375,583円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A 2<適格機関投資家専用>	98,336,933円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A 2<適格機関投資家専用>	39,422,989円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A 2<適格機関投資家専用>	5,252,180円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L 2<適格機関投資家専用>	991,937,006円
S M A M・グローバルバランスファンド(標準型)V A<適格機関投資家限定>	577,077,596円
S M A M・グローバルバランスファンド(債券重視型)V A<適格機関投資家限定>	847,744,078円
S M A M・世界バランスファンドV A<適格機関投資家限定>	754,418,443円
S M A M・世界バランスファンドV A 2<適格機関投資家限定>	341,578,053円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	190,502,250円
S M A M・マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4<適格機関投資家限定>	124,850,498円
S M A M・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	159,858,275円
S M A M・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド <適格機関投資家限定>	211,033,507円
合 計	78,572,267,228円

## ( 3 ) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a)株式

該当事項はありません。

## (b)株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券		T 0.125 02/15/24	7,700,000.00	7,363,664.00	

アメリカ・ドル	T 0.125 07/15/23	4,300,000.00	4,190,479.00	
	T 0.125 08/15/23	8,000,000.00	7,774,960.00	
	T 0.125 10/15/23	5,700,000.00	5,512,926.00	
	T 0.25 04/15/23	5,000,000.00	4,914,450.00	
	T 0.25 06/15/23	7,700,000.00	7,539,917.00	
	T 0.25 06/30/25	2,400,000.00	2,212,104.00	
	T 0.25 07/31/25	3,300,000.00	3,033,921.00	
	T 0.25 09/30/25	2,000,000.00	1,830,620.00	
	T 0.25 11/15/23	3,000,000.00	2,901,090.00	
	T 0.375 04/30/25	200,000.00	185,976.00	
	T 0.375 07/31/27	4,700,000.00	4,130,830.00	
	T 0.375 09/15/24	3,000,000.00	2,835,690.00	
	T 0.375 09/30/27	4,800,000.00	4,201,104.00	
	T 0.375 11/30/25	2,000,000.00	1,830,000.00	
	T 0.375 12/31/25	3,000,000.00	2,739,360.00	
	T 0.5 03/31/25	600,000.00	561,114.00	
	T 0.5 04/30/27	200,000.00	178,014.00	
	T 0.5 05/31/27	3,000,000.00	2,662,830.00	
	T 0.5 06/30/27	4,400,000.00	3,898,620.00	
	T 0.625 03/31/27	600,000.00	538,146.00	
	T 0.625 05/15/30	7,500,000.00	6,319,275.00	
	T 0.625 07/31/26	3,600,000.00	3,275,280.00	
	T 0.625 08/15/30	8,800,000.00	7,374,048.00	
	T 0.625 10/15/24	4,400,000.00	4,176,216.00	
	T 0.625 11/30/27	2,100,000.00	1,855,707.00	
	T 0.625 12/31/27	7,200,000.00	6,350,616.00	
	T 0.75 01/31/28	6,700,000.00	5,937,339.00	
	T 0.75 11/15/24	5,200,000.00	4,940,988.00	
	T 0.875 11/15/30	7,000,000.00	5,972,960.00	
	T 1 07/31/28	5,900,000.00	5,263,390.00	
	T 1 12/15/24	4,500,000.00	4,296,960.00	
	T 1.125 02/15/31	8,500,000.00	7,387,010.00	
	T 1.125 02/28/25	1,500,000.00	1,431,615.00	
	T 1.125 02/28/27	2,000,000.00	1,843,280.00	
	T 1.125 05/15/40	2,000,000.00	1,462,500.00	
	T 1.125 08/15/40	700,000.00	509,250.00	
	T 1.125 08/31/28	3,500,000.00	3,142,335.00	
	T 1.25 05/15/50	5,100,000.00	3,459,228.00	
	T 1.25 06/30/28	3,000,000.00	2,721,540.00	
	T 1.25 07/31/23	3,000,000.00	2,962,710.00	
T 1.25 08/15/31	5,500,000.00	4,795,285.00		
T 1.25 09/30/28	4,500,000.00	4,067,190.00		
T 1.25 11/30/26	4,200,000.00	3,907,470.00		
T 1.25 12/31/26	2,300,000.00	2,136,562.00		

T 1.375 01/31/25	1,900,000.00	1,828,294.00	
T 1.375 06/30/23	500,000.00	495,000.00	
T 1.375 08/15/50	4,500,000.00	3,150,315.00	
T 1.375 08/31/23	2,500,000.00	2,468,750.00	
T 1.375 08/31/26	7,100,000.00	6,666,190.00	
T 1.375 09/30/23	3,000,000.00	2,959,200.00	
T 1.375 10/31/28	6,000,000.00	5,463,240.00	
T 1.375 11/15/31	4,900,000.00	4,308,521.00	
T 1.375 11/15/40	2,000,000.00	1,517,960.00	
T 1.375 12/31/28	2,500,000.00	2,273,625.00	
T 1.5 01/31/27	2,400,000.00	2,254,008.00	
T 1.5 02/15/30	4,500,000.00	4,086,900.00	
T 1.5 03/31/23	1,500,000.00	1,493,250.00	
T 1.5 10/31/24	5,500,000.00	5,329,390.00	
T 1.5 11/30/24	800,000.00	774,432.00	
T 1.5 11/30/28	2,300,000.00	2,109,698.00	
T 1.625 02/15/26	2,900,000.00	2,770,631.00	
T 1.625 04/30/23	3,000,000.00	2,986,170.00	
T 1.625 05/15/26	14,950,000.00	14,236,287.00	
T 1.625 05/15/31	4,300,000.00	3,891,156.00	
T 1.625 05/31/23	3,000,000.00	2,984,040.00	
T 1.625 08/15/29	2,450,000.00	2,256,278.50	
T 1.625 09/30/26	3,900,000.00	3,699,501.00	
T 1.625 10/31/23	3,000,000.00	2,966,250.00	
T 1.625 11/15/50	3,200,000.00	2,391,232.00	
T 1.625 11/30/26	200,000.00	189,358.00	
T 1.75 01/31/29	4,300,000.00	4,004,676.00	
T 1.75 03/15/25	1,500,000.00	1,456,230.00	
T 1.75 05/15/23	2,700,000.00	2,690,280.00	
T 1.75 06/30/24	6,200,000.00	6,076,434.00	
T 1.75 07/31/24	850,000.00	832,201.00	
T 1.75 08/15/41	3,500,000.00	2,811,725.00	
T 1.75 11/15/29	4,000,000.00	3,712,480.00	
T 1.75 12/31/26	3,500,000.00	3,329,375.00	
T 1.875 02/15/32	4,200,000.00	3,861,018.00	
T 1.875 02/15/51	5,800,000.00	4,618,250.00	
T 1.875 02/28/27	1,200,000.00	1,146,600.00	
T 1.875 02/28/29	2,800,000.00	2,628,920.00	
T 1.875 08/31/24	3,800,000.00	3,725,482.00	
T 1.875 11/15/51	1,300,000.00	1,035,528.00	
T 2 02/15/25	3,500,000.00	3,423,980.00	
T 2 02/15/50	2,800,000.00	2,296,644.00	
T 2 04/30/24	2,000,000.00	1,975,000.00	
T 2 05/31/24	3,300,000.00	3,255,384.00	

T 2 06/30/24	4,100,000.00	4,040,099.00	
T 2 08/15/25	4,300,000.00	4,187,770.00	
T 2 08/15/51	4,700,000.00	3,854,000.00	
T 2 11/15/26	5,000,000.00	4,809,750.00	
T 2.125 02/29/24	2,000,000.00	1,982,500.00	
T 2.125 03/31/24	6,500,000.00	6,436,495.00	
T 2.125 05/15/25	1,900,000.00	1,861,107.00	
T 2.125 07/31/24	3,500,000.00	3,455,410.00	
T 2.125 09/30/24	4,000,000.00	3,941,240.00	
T 2.125 11/30/23	3,100,000.00	3,085,461.00	
T 2.125 11/30/24	2,600,000.00	2,556,918.00	
T 2.25 01/31/24	2,200,000.00	2,185,898.00	
T 2.25 02/15/27	4,400,000.00	4,275,876.00	
T 2.25 02/15/52	700,000.00	610,582.00	
T 2.25 03/31/26	13,300,000.00	12,994,499.00	
T 2.25 04/30/24	3,800,000.00	3,771,196.00	
T 2.25 05/15/41	3,000,000.00	2,634,600.00	
T 2.25 08/15/27	4,200,000.00	4,073,328.00	
T 2.25 08/15/46	2,450,000.00	2,106,608.00	
T 2.25 08/15/49	3,500,000.00	3,043,355.00	
T 2.25 10/31/24	800,000.00	789,808.00	
T 2.25 11/15/24	5,100,000.00	5,033,445.00	
T 2.25 11/15/25	4,000,000.00	3,920,920.00	
T 2.25 11/15/27	4,400,000.00	4,259,024.00	
T 2.25 12/31/23	3,000,000.00	2,985,450.00	
T 2.25 12/31/24	3,900,000.00	3,845,127.00	
T 2.375 02/15/42	3,600,000.00	3,223,656.00	
T 2.375 02/29/24	3,700,000.00	3,684,090.00	
T 2.375 05/15/27	1,000,000.00	977,140.00	
T 2.375 05/15/29	400,000.00	387,812.00	
T 2.375 05/15/51	1,400,000.00	1,251,572.00	
T 2.375 08/15/24	5,600,000.00	5,553,576.00	
T 2.375 11/15/49	1,900,000.00	1,699,303.00	
T 2.5 01/31/25	3,400,000.00	3,373,548.00	
T 2.5 02/15/45	3,600,000.00	3,241,656.00	
T 2.5 02/15/46	2,900,000.00	2,617,250.00	
T 2.5 02/28/26	8,500,000.00	8,380,405.00	
T 2.5 05/15/24	5,700,000.00	5,683,470.00	
T 2.5 05/15/46	3,600,000.00	3,249,828.00	
T 2.5 08/15/23	5,000,000.00	5,013,650.00	
T 2.625 01/31/26	2,700,000.00	2,676,375.00	
T 2.625 02/15/29	1,800,000.00	1,773,414.00	
T 2.625 03/31/25	1,000,000.00	994,680.00	
T 2.625 12/31/23	1,900,000.00	1,902,660.00	

T 2.625 12/31/25	4,400,000.00	4,363,040.00	
T 2.75 02/15/24	5,100,000.00	5,111,934.00	
T 2.75 02/15/28	4,800,000.00	4,766,976.00	
T 2.75 02/28/25	2,000,000.00	1,996,700.00	
T 2.75 04/30/23	2,900,000.00	2,920,155.00	
T 2.75 05/31/23	1,000,000.00	1,006,560.00	
T 2.75 06/30/25	4,600,000.00	4,587,948.00	
T 2.75 07/31/23	2,000,000.00	2,012,020.00	
T 2.75 08/15/42	2,000,000.00	1,891,160.00	
T 2.75 08/15/47	3,600,000.00	3,427,020.00	
T 2.75 08/31/23	3,800,000.00	3,820,178.00	
T 2.75 08/31/25	2,100,000.00	2,093,595.00	
T 2.75 11/15/23	4,200,000.00	4,218,690.00	
T 2.75 11/15/42	300,000.00	283,263.00	
T 2.75 11/15/47	1,500,000.00	1,427,460.00	
T 2.875 04/30/25	2,200,000.00	2,203,256.00	
T 2.875 05/15/28	9,000,000.00	9,000,630.00	
T 2.875 05/15/43	2,400,000.00	2,308,872.00	
T 2.875 05/15/49	1,400,000.00	1,380,750.00	
T 2.875 05/31/25	1,100,000.00	1,101,452.00	
T 2.875 08/15/28	4,500,000.00	4,501,035.00	
T 2.875 08/15/45	3,300,000.00	3,177,768.00	
T 2.875 10/31/23	1,000,000.00	1,007,100.00	
T 2.875 11/15/46	300,000.00	290,904.00	
T 2.875 11/30/23	2,000,000.00	2,011,860.00	
T 2.875 11/30/25	2,500,000.00	2,502,325.00	
T 3 02/15/47	2,500,000.00	2,480,075.00	
T 3 02/15/48	2,400,000.00	2,403,168.00	
T 3 02/15/49	3,300,000.00	3,330,657.00	
T 3 05/15/42	800,000.00	789,184.00	
T 3 05/15/45	3,000,000.00	2,949,600.00	
T 3 05/15/47	1,800,000.00	1,787,904.00	
T 3 08/15/48	900,000.00	901,404.00	
T 3 09/30/25	4,000,000.00	4,024,040.00	
T 3 10/31/25	3,100,000.00	3,118,135.00	
T 3 11/15/44	3,500,000.00	3,437,630.00	
T 3 11/15/45	2,700,000.00	2,660,553.00	
T 3.125 02/15/42	1,000,000.00	1,006,250.00	
T 3.125 02/15/43	2,300,000.00	2,303,220.00	
T 3.125 05/15/48	2,400,000.00	2,464,488.00	
T 3.125 08/15/44	3,300,000.00	3,303,861.00	
T 3.125 11/15/28	2,900,000.00	2,943,500.00	
T 3.375 05/15/44	3,000,000.00	3,124,200.00	
T 3.375 11/15/48	3,100,000.00	3,337,088.00	



T 3.5 02/15/39	200,000.00	214,906.00	
T 3.625 02/15/44	3,600,000.00	3,895,308.00	
T 3.625 08/15/43	2,400,000.00	2,594,520.00	
T 3.75 08/15/41	1,500,000.00	1,648,125.00	
T 3.75 11/15/43	700,000.00	770,819.00	
T 3.875 08/15/40	500,000.00	559,175.00	
T 4.25 05/15/39	100,000.00	117,648.00	
T 4.25 11/15/40	600,000.00	702,468.00	
T 4.375 05/15/40	900,000.00	1,073,952.00	
T 4.375 05/15/41	300,000.00	356,835.00	
T 4.375 11/15/39	700,000.00	834,036.00	
T 4.5 08/15/39	300,000.00	363,750.00	
T 4.625 02/15/40	1,100,000.00	1,353,935.00	
T 4.75 02/15/41	900,000.00	1,122,750.00	
T 5.25 11/15/28	500,000.00	570,935.00	
T 5.375 02/15/31	320,000.00	383,974.40	
T 6 02/15/26	1,000,000.00	1,114,060.00	
T 6.25 08/15/23	800,000.00	840,432.00	
T-BOND 15/11/2027	1,000,000.00	1,166,320.00	
アメリカ・ドル小計	629,920,000.00	596,940,559.90 (76,169,615,443)	
カナダ・ドル	CAN 0.5 09/01/25	2,700,000.00	2,512,809.00
	CAN 1 06/01/27	600,000.00	552,672.00
	CAN 1.25 06/01/30	6,000,000.00	5,346,360.00
	CAN 1.5 06/01/23	1,200,000.00	1,188,828.00
	CAN 1.5 06/01/26	3,200,000.00	3,057,344.00
	CAN 1.5 09/01/24	2,000,000.00	1,951,900.00
	CAN 1.5 12/01/31	400,000.00	356,568.00
	CAN 1.75 12/01/53	500,000.00	392,245.00
	CAN 2 06/01/28	700,000.00	673,505.00
	CAN 2 09/01/23	1,200,000.00	1,193,448.00
	CAN 2.25 03/01/24	1,000,000.00	995,220.00
	CAN 2.25 06/01/25	1,000,000.00	988,850.00
	CAN 2.25 06/01/29	1,900,000.00	1,843,361.00
	CAN 2.5 06/01/24	2,100,000.00	2,097,564.00
	CAN 2.75 12/01/48	1,300,000.00	1,291,563.00
	CAN 3.5 12/01/45	1,200,000.00	1,340,580.00
	CAN 4 06/01/41	1,800,000.00	2,102,868.00
	CAN 5 06/01/37	1,450,000.00	1,827,058.00
	CAN 5.75 06/01/29	250,000.00	298,577.50
	CAN 5.75 06/01/33	400,000.00	509,772.00
CANADA 2.75 12/01/64	700,000.00	686,917.00	
カナダ・ドル小計	31,600,000.00	31,208,009.50 (3,127,354,632)	

オーストラリア・ドル	ACGB 0.25 11/21/25	800,000.00	730,808.00	
	ACGB 1.5 06/21/31	2,800,000.00	2,444,232.00	
	ACGB 1.75 06/21/51	500,000.00	340,285.00	
	ACGB 2.25 05/21/28	2,400,000.00	2,300,280.00	
	ACGB 2.5 05/21/30	2,250,000.00	2,158,897.50	
	ACGB 2.75 04/21/24	2,500,000.00	2,517,775.00	
	ACGB 2.75 06/21/35	800,000.00	757,744.00	
	ACGB 2.75 11/21/27	900,000.00	889,902.00	
	ACGB 2.75 11/21/28	200,000.00	196,750.00	
	ACGB 2.75 11/21/29	2,500,000.00	2,448,900.00	
	ACGB 3 03/21/47	1,200,000.00	1,098,348.00	
	ACGB 3.25 04/21/25	1,300,000.00	1,320,605.00	
	ACGB 3.25 04/21/29	800,000.00	810,768.00	
	ACGB 3.25 06/21/39	2,550,000.00	2,499,025.50	
	ACGB 3.75 04/21/37	1,200,000.00	1,260,456.00	
	ACGB 4.25 04/21/26	2,650,000.00	2,790,423.50	
	ACGB 4.5 04/21/33	1,100,000.00	1,238,413.00	
ACGB 5.5 04/21/23	900,000.00	933,579.00		
オーストラリア・ドル小計		27,350,000.00	26,737,191.50 (2,453,672,064)	
シンガポール・ドル	SIGB 1.25 11/01/26	100,000.00	95,510.00	
	SIGB 1.625 07/01/31	200,000.00	185,562.00	
	SIGB 2.25 08/01/36	1,200,000.00	1,135,020.00	
	SIGB 2.625 05/01/28	800,000.00	809,600.00	
	SIGB 2.75 03/01/46	700,000.00	698,950.00	
	SIGB 2.75 04/01/42	400,000.00	399,384.00	
	SIGB 2.75 07/01/23	1,200,000.00	1,214,520.00	
	SIGB 2.875 09/01/30	200,000.00	205,400.00	
	SIGB 3 09/01/24	100,000.00	102,180.00	
	SIGB 3.375 09/01/33	750,000.00	802,500.00	
	SIGB 3.5 03/01/27	1,500,000.00	1,575,060.00	
シンガポール・ドル小計		7,150,000.00	7,223,686.00 (671,513,851)	
イギリス・ポンド	UK TSY GILT	400,000.00	348,720.00	
	UKT 0.125 01/30/26	1,500,000.00	1,420,140.00	
	UKT 0.25 01/31/25	300,000.00	288,555.00	
	UKT 0.25 07/31/31	1,600,000.00	1,385,136.00	
	UKT 0.375 10/22/30	1,800,000.00	1,605,366.00	
	UKT 0.5 01/31/29	700,000.00	644,966.00	
	UKT 0.5 10/22/61	100,000.00	64,036.00	
	UKT 0.625 06/07/25	800,000.00	776,680.00	
	UKT 0.625 07/31/35	600,000.00	503,142.00	
	UKT 0.75 07/22/23	1,700,000.00	1,685,448.00	
	UKT 0.875 10/22/29	500,000.00	470,275.00	

UKT 1 04/22/24	800,000.00	791,336.00	
UKT 1.125 10/22/73	300,000.00	245,007.00	
UKT 1.25 07/22/27	200,000.00	196,260.00	
UKT 1.5 07/22/26	1,100,000.00	1,095,039.00	
UKT 1.5 07/22/47	2,000,000.00	1,810,200.00	
UKT 1.625 10/22/28	900,000.00	898,569.00	
UKT 1.625 10/22/54	500,000.00	467,430.00	
UKT 1.75 01/22/49	850,000.00	813,220.50	
UKT 1.75 09/07/37	100,000.00	96,433.00	
UKT 2 09/07/25	1,100,000.00	1,114,663.00	
UKT 2.25 09/07/23	2,700,000.00	2,726,325.00	
UKT 2.5 07/22/65	1,600,000.00	1,955,616.00	
UKT 2.75 09/07/24	900,000.00	924,003.00	
UKT 3.25 01/22/44	1,600,000.00	1,944,768.00	
UKT 3.5 01/22/45	1,250,000.00	1,587,475.00	
UKT 3.5 07/22/68	1,450,000.00	2,244,498.50	
UKT 3.75 07/22/52	1,200,000.00	1,697,016.00	
UKT 4 01/22/60	1,600,000.00	2,556,560.00	
UKT 4.25 03/07/36	900,000.00	1,146,447.00	
UKT 4.25 06/07/32	300,000.00	366,315.00	
UKT 4.25 09/07/39	750,000.00	996,817.50	
UKT 4.25 12/07/27	900,000.00	1,023,552.00	
UKT 4.25 12/07/40	600,000.00	807,336.00	
UKT 4.25 12/07/46	1,500,000.00	2,148,315.00	
UKT 4.25 12/07/49	900,000.00	1,335,870.00	
UKT 4.25 12/07/55	1,700,000.00	2,703,034.00	
UKT 4.5 09/07/34	1,100,000.00	1,406,603.00	
UKT 4.5 12/07/42	1,250,000.00	1,771,987.50	
UKT 4.75 12/07/30	1,150,000.00	1,426,540.50	
UKT 4.75 12/07/38	1,000,000.00	1,390,370.00	
UKT 5 03/07/25	1,300,000.00	1,420,367.00	
UKT 6 12/07/28	650,000.00	825,064.50	
イギリス・ポンド小計		44,150,000.00	51,125,502.00 (8,315,051,644)
イスラエル・シケル	ILGOV 0.15 07/31/23	5,800,000.00	5,724,484.00
	ILGOV 1.5 11/30/23	2,200,000.00	2,205,698.00
	ILGOV 2.25 09/28/28	1,500,000.00	1,504,995.00
	ILGOV 3.75 03/31/47	4,000,000.00	4,459,200.00
	ILGOV 6.25 10/30/26	2,900,000.00	3,434,180.00
イスラエル・シケル小計		16,400,000.00	17,328,557.00 (673,259,494)
デンマーク・クローネ	DGB 0.25 11/15/52	1,800,000.00	1,327,050.00
	DGB 0.5 11/15/27	8,500,000.00	8,316,485.00
	DGB 0.5 11/15/29	4,300,000.00	4,146,705.00

	DGB 1.5 11/15/23	3,000,000.00	3,069,330.00	
	DGB 1.75 11/15/25	3,100,000.00	3,215,537.00	
	DGB 4.5 11/15/39	9,500,000.00	14,354,500.00	
	デンマーク・クローネ小計	30,200,000.00	34,429,607.00 (633,504,769)	
ノル ウェー・ クローネ	NGB 1.375 08/19/30	3,200,000.00	2,887,584.00	
	NGB 1.5 02/19/26	3,500,000.00	3,368,225.00	
	NGB 1.75 03/13/25	3,000,000.00	2,941,530.00	
	NGB 1.75 09/06/29	4,200,000.00	3,939,348.00	
	NGB 2 04/26/28	9,000,000.00	8,686,440.00	
	NGB 2 05/24/23	3,300,000.00	3,311,847.00	
	NGB 3 03/14/24	4,300,000.00	4,365,016.00	
	ノルウェー・クローネ小計	30,500,000.00	29,499,990.00 (413,294,860)	
スウェー デン・ク ローナ	SGB 0.75 05/12/28	3,700,000.00	3,550,002.00	
	SGB 0.75 11/12/29	6,400,000.00	6,058,112.00	
	SGB 1 11/12/26	5,800,000.00	5,706,852.00	
	SGB 1.5 11/13/23	6,900,000.00	6,965,343.00	
	SGB 2.5 05/12/25	5,000,000.00	5,189,150.00	
	SGB 3.5 03/30/39	4,600,000.00	5,824,106.00	
	スウェーデン・クローナ小 計	32,400,000.00	33,293,565.00 (437,810,380)	
メキシ コ・ペソ	MBONO 10 12/05/24	32,000,000.00	32,706,560.00	
	MBONO 5.75 03/05/26	19,000,000.00	17,001,390.00	
	MBONO 7.5 06/03/27	25,000,000.00	23,574,250.00	
	MBONO 7.75 05/29/31	5,000,000.00	4,649,000.00	
	MBONO 7.75 11/23/34	18,000,000.00	16,427,520.00	
	MBONO 8 11/07/47	5,000,000.00	4,508,850.00	
	MBONO 8 12/07/23	21,000,000.00	20,733,510.00	
	MBONO 8.5 05/31/29	23,000,000.00	22,545,290.00	
	MBONO 8.5 11/18/38	40,000,000.00	38,590,800.00	
	メキシコ・ペソ小計	188,000,000.00	180,737,170.00 (1,140,578,059)	
オフショ ア・人民 元	CGB 2.26 02/24/25	5,000,000.00	4,983,000.00	
	CGB 2.47 09/02/24	26,000,000.00	26,072,280.00	
	CGB 2.56 10/21/23	11,000,000.00	11,064,570.00	
	CGB 2.69 08/12/26	32,000,000.00	32,150,400.00	
	CGB 2.8 03/24/29	3,000,000.00	2,993,850.00	
	CGB 2.91 10/14/28	14,000,000.00	14,098,840.00	
	CGB 3.02 05/27/31	17,000,000.00	17,195,670.00	
	CGB 3.72 04/12/51	11,000,000.00	11,728,640.00	
	オフショア・人民元小計	119,000,000.00	120,287,250.00 (2,335,918,250)	
	MALAYSIA GOVT	700,000.00	701,519.00	
	MALAYSIA GOVT	700,000.00	701,435.00	

マレーシア・リングット	MGS 3.502 05/31/27	7,900,000.00	7,762,856.00	
	MGS 3.955 09/15/25	4,700,000.00	4,742,488.00	
	MGS 4.498 04/15/30	6,000,000.00	6,046,620.00	
	MGS 4.736 03/15/46	6,700,000.00	6,451,765.00	
マレーシア・リングット小計		26,700,000.00	26,406,683.00 (774,378,620)	
ポーランド・ズロチ	POLGB 0 04/25/23	300,000.00	284,160.00	
	POLGB 0.25 10/25/26	7,000,000.00	5,313,000.00	
	POLGB 0.75 04/25/25	1,800,000.00	1,523,520.00	
	POLGB 1.25 10/25/30	6,500,000.00	4,468,750.00	
	POLGB 2.25 10/25/24	12,500,000.00	11,288,750.00	
ポーランド・ズロチ小計		28,100,000.00	22,878,180.00 (674,604,318)	
ユーロ	BGB 0 10/22/31	1,300,000.00	1,152,112.00	
	BGB 0.1 06/22/30	700,000.00	645,568.00	
	BGB 0.4 06/22/40	300,000.00	237,834.00	
	BGB 0.5 10/22/24	1,300,000.00	1,305,993.00	
	BGB 0.65 06/22/71	400,000.00	237,760.00	
	BGB 0.8 06/22/25	300,000.00	302,994.00	
	BGB 0.8 06/22/27	1,000,000.00	1,000,290.00	
	BGB 0.8 06/22/28	1,600,000.00	1,591,776.00	
	BGB 0.9 06/22/29	900,000.00	893,565.00	
	BGB 1 06/22/26	1,800,000.00	1,826,982.00	
	BGB 1 06/22/31	1,300,000.00	1,277,848.00	
	BGB 1.25 04/22/33	1,200,000.00	1,195,656.00	
	BGB 1.45 06/22/37	400,000.00	389,880.00	
	BGB 1.6 06/22/47	650,000.00	619,976.50	
	BGB 1.7 06/22/50	500,000.00	484,105.00	
	BGB 1.9 06/22/38	1,000,000.00	1,038,530.00	
	BGB 2.15 06/22/66	500,000.00	536,845.00	
	BGB 2.25 06/22/23	1,300,000.00	1,337,310.00	
	BGB 2.25 06/22/57	500,000.00	547,915.00	
	BGB 2.6 06/22/24	800,000.00	840,928.00	
	BGB 3 06/22/34	200,000.00	234,372.00	
	BGB 3.75 06/22/45	800,000.00	1,090,656.00	
	BGB 4 03/28/32	500,000.00	626,880.00	
	BGB 4.25 03/28/41	1,000,000.00	1,395,620.00	
	BGB 4.5 03/28/26	700,000.00	807,506.00	
	BGB 5 03/28/35	1,000,000.00	1,407,040.00	
	BGB 5.5 03/28/28	1,100,000.00	1,400,201.00	
BTPS 0 12/15/24	1,300,000.00	1,261,481.00		
BTPS 0.35 02/01/25	2,400,000.00	2,349,528.00		
BTPS 0.5 02/01/26	1,000,000.00	965,970.00		
BTPS 0.65 10/15/23	2,000,000.00	2,010,820.00		

BTPS 0.85 01/15/27	1,700,000.00	1,637,678.00	
BTPS 0.9 04/01/31	2,000,000.00	1,750,480.00	
BTPS 0.95 08/01/30	1,800,000.00	1,611,000.00	
BTPS 0.95 09/15/27	800,000.00	765,472.00	
BTPS 0.95 12/01/31	1,100,000.00	953,150.00	
BTPS 1.25 12/01/26	800,000.00	787,288.00	
BTPS 1.45 03/01/36	1,100,000.00	942,480.00	
BTPS 1.45 05/15/25	700,000.00	704,207.00	
BTPS 1.45 11/15/24	1,800,000.00	1,815,102.00	
BTPS 1.5 06/01/25	2,700,000.00	2,722,815.00	
BTPS 1.6 06/01/26	1,200,000.00	1,204,320.00	
BTPS 1.65 12/01/30	2,200,000.00	2,071,652.00	
BTPS 1.7 09/01/51	1,500,000.00	1,124,565.00	
BTPS 1.85 05/15/24	3,000,000.00	3,064,890.00	
BTPS 1.85 07/01/25	1,000,000.00	1,015,940.00	
BTPS 2 02/01/28	3,900,000.00	3,929,016.00	
BTPS 2 12/01/25	1,300,000.00	1,327,937.00	
BTPS 2.05 08/01/27	1,500,000.00	1,519,635.00	
BTPS 2.1 07/15/26	1,000,000.00	1,022,850.00	
BTPS 2.2 06/01/27	900,000.00	920,718.00	
BTPS 2.25 09/01/36	500,000.00	472,865.00	
BTPS 2.45 09/01/33	1,100,000.00	1,086,250.00	
BTPS 2.45 09/01/50	900,000.00	800,100.00	
BTPS 2.5 11/15/25	2,100,000.00	2,182,089.00	
BTPS 2.5 12/01/24	1,300,000.00	1,349,205.00	
BTPS 2.7 03/01/47	1,550,000.00	1,484,667.50	
BTPS 2.8 03/01/67	600,000.00	544,614.00	
BTPS 2.8 12/01/28	1,000,000.00	1,048,530.00	
BTPS 2.95 09/01/38	800,000.00	816,072.00	
BTPS 3 08/01/29	2,700,000.00	2,852,010.00	
BTPS 3.1 03/01/40	500,000.00	516,545.00	
BTPS 3.25 09/01/46	1,500,000.00	1,580,340.00	
BTPS 3.35 03/01/35	850,000.00	911,472.00	
BTPS 3.45 03/01/48	1,000,000.00	1,084,880.00	
BTPS 3.5 03/01/30	4,400,000.00	4,816,724.00	
BTPS 3.75 09/01/24	2,300,000.00	2,452,191.00	
BTPS 3.85 09/01/49	1,100,000.00	1,269,521.00	
BTPS 4 02/01/37	2,600,000.00	3,003,000.00	
BTPS 4.5 03/01/24	1,000,000.00	1,072,020.00	
BTPS 4.5 03/01/26	1,800,000.00	2,010,222.00	
BTPS 4.5 05/01/23	2,300,000.00	2,406,421.00	
BTPS 4.75 08/01/23	2,500,000.00	2,647,400.00	
BTPS 4.75 09/01/28	2,000,000.00	2,329,320.00	
BTPS 4.75 09/01/44	1,400,000.00	1,820,420.00	

BTPS 5 03/01/25	1,000,000.00	1,109,040.00	
BTPS 5 08/01/34	2,070,000.00	2,597,746.50	
BTPS 5 08/01/39	1,800,000.00	2,333,700.00	
BTPS 5 09/01/40	1,700,000.00	2,220,676.00	
BTPS 5.75 02/01/33	1,700,000.00	2,220,710.00	
BTPS 6 05/01/31	2,200,000.00	2,855,314.00	
BTPS 6.5 11/01/27	1,700,000.00	2,124,558.00	
BTPS 7.25 11/01/26	400,000.00	499,828.00	
BTPS 9 11/01/23	300,000.00	339,129.00	
DBR 0 02/15/30	1,300,000.00	1,228,981.00	
DBR 0 02/15/32	400,000.00	368,356.00	
DBR 0 05/15/35	4,100,000.00	3,623,293.00	
DBR 0 08/15/29	2,600,000.00	2,471,300.00	
DBR 0 08/15/30	5,800,000.00	5,453,566.00	
DBR 0 08/15/31	1,500,000.00	1,394,775.00	
DBR 0 08/15/50	2,800,000.00	2,131,052.00	
DBR 0.25 02/15/27	2,300,000.00	2,268,306.00	
DBR 0.25 02/15/29	1,800,000.00	1,748,664.00	
DBR 0.25 08/15/28	1,500,000.00	1,461,330.00	
DBR 0.5 02/15/25	2,500,000.00	2,512,750.00	
DBR 0.5 02/15/26	3,100,000.00	3,103,844.00	
DBR 0.5 02/15/28	2,100,000.00	2,082,423.00	
DBR 0.5 08/15/27	3,400,000.00	3,381,334.00	
DBR 1 08/15/24	1,300,000.00	1,323,062.00	
DBR 1 08/15/25	2,050,000.00	2,090,077.50	
DBR 1.25 08/15/48	1,450,000.00	1,551,761.00	
DBR 1.5 05/15/23	1,300,000.00	1,324,505.00	
DBR 1.5 05/15/24	3,600,000.00	3,697,848.00	
DBR 1.75 02/15/24	2,200,000.00	2,266,088.00	
DBR 2 08/15/23	2,000,000.00	2,058,460.00	
DBR 2.5 07/04/44	2,200,000.00	2,897,114.00	
DBR 2.5 08/15/46	2,500,000.00	3,364,250.00	
DBR 3.25 07/04/42	700,000.00	998,403.00	
DBR 4 01/04/37	1,800,000.00	2,563,668.00	
DBR 4.25 07/04/39	700,000.00	1,066,688.00	
DBR 4.75 07/04/28	1,600,000.00	1,999,792.00	
DBR 4.75 07/04/34	600,000.00	871,482.00	
DBR 4.75 07/04/40	1,450,000.00	2,369,633.50	
DBR 5.5 01/04/31	900,000.00	1,260,522.00	
DBR 5.625 01/04/28	1,000,000.00	1,280,420.00	
DBR 6.25 01/04/24	1,200,000.00	1,326,888.00	
DBR 6.25 01/04/30	500,000.00	708,495.00	
DBR 6.5 07/04/27	1,000,000.00	1,301,540.00	
FRTR 0 02/25/24	1,900,000.00	1,894,053.00	

FRTR 0 02/25/26	4,300,000.00	4,190,221.00	
FRTR 0 03/25/24	4,800,000.00	4,778,592.00	
FRTR 0 03/25/25	1,900,000.00	1,871,728.00	
FRTR 0 11/25/29	4,500,000.00	4,153,230.00	
FRTR 0 11/25/30	3,900,000.00	3,529,617.00	
FRTR 0 11/25/31	3,400,000.00	3,012,638.00	
FRTR 0.25 11/25/26	3,200,000.00	3,126,336.00	
FRTR 0.5 05/25/25	1,300,000.00	1,298,258.00	
FRTR 0.5 05/25/26	3,500,000.00	3,471,090.00	
FRTR 0.5 05/25/29	200,000.00	193,056.00	
FRTR 0.5 05/25/72	100,000.00	56,040.00	
FRTR 0.75 05/25/28	3,300,000.00	3,269,409.00	
FRTR 0.75 05/25/52	3,000,000.00	2,289,810.00	
FRTR 0.75 11/25/28	3,500,000.00	3,454,885.00	
FRTR 1 05/25/27	1,800,000.00	1,815,660.00	
FRTR 1 11/25/25	2,050,000.00	2,076,998.50	
FRTR 1.25 05/25/34	4,100,000.00	4,011,727.00	
FRTR 1.25 05/25/36	3,700,000.00	3,570,463.00	
FRTR 1.5 05/25/31	2,550,000.00	2,621,502.00	
FRTR 1.5 05/25/50	2,400,000.00	2,273,688.00	
FRTR 1.75 05/25/23	4,200,000.00	4,288,242.00	
FRTR 1.75 05/25/66	800,000.00	784,728.00	
FRTR 1.75 06/25/39	2,500,000.00	2,583,525.00	
FRTR 1.75 11/25/24	2,600,000.00	2,687,490.00	
FRTR 2 05/25/48	2,000,000.00	2,118,420.00	
FRTR 2.25 05/25/24	1,700,000.00	1,768,935.00	
FRTR 2.5 05/25/30	3,500,000.00	3,889,445.00	
FRTR 2.75 10/25/27	3,850,000.00	4,245,279.50	
FRTR 3.25 05/25/45	1,400,000.00	1,817,214.00	
FRTR 3.5 04/25/26	2,500,000.00	2,778,825.00	
FRTR 4 04/25/55	1,370,000.00	2,126,870.20	
FRTR 4 04/25/60	1,400,000.00	2,245,376.00	
FRTR 4 10/25/38	2,000,000.00	2,717,560.00	
FRTR 4.25 10/25/23	1,000,000.00	1,063,130.00	
FRTR 4.5 04/25/41	2,000,000.00	2,929,720.00	
FRTR 4.75 04/25/35	2,200,000.00	3,067,614.00	
FRTR 5.5 04/25/29	2,350,000.00	3,073,236.00	
FRTR 5.75 10/25/32	400,000.00	574,968.00	
FRTR 6 10/25/25	3,000,000.00	3,562,170.00	
FRTR 8.5 04/25/23	600,000.00	652,536.00	
IRISH 0.9 05/15/28	700,000.00	696,927.00	
IRISH 1 05/15/26	600,000.00	607,830.00	
IRISH 1.1 05/15/29	1,600,000.00	1,602,256.00	
IRISH 1.3 05/15/33	1,000,000.00	980,680.00	



IRISH 1.35 03/18/31	500,000.00	505,745.00	
IRISH 1.5 05/15/50	500,000.00	468,690.00	
IRISH 1.7 05/15/37	300,000.00	303,987.00	
IRISH 2 02/18/45	900,000.00	949,851.00	
IRISH 2.4 05/15/30	600,000.00	658,428.00	
IRISH 3.4 03/18/24	500,000.00	529,845.00	
IRISH 5.4 03/13/25	800,000.00	911,248.00	
NETHER 0 01/15/24	1,000,000.00	999,030.00	
NETHER 0 01/15/27	800,000.00	774,616.00	
NETHER 0 07/15/30	2,600,000.00	2,404,376.00	
NETHER 0.25 07/15/25	1,700,000.00	1,688,423.00	
NETHER 0.25 07/15/29	500,000.00	477,505.00	
NETHER 0.5 01/15/40	1,700,000.00	1,512,677.00	
NETHER 0.5 07/15/26	1,700,000.00	1,692,452.00	
NETHER 0.75 07/15/27	400,000.00	400,404.00	
NETHER 0.75 07/15/28	1,500,000.00	1,494,150.00	
NETHER 1.75 07/15/23	800,000.00	819,960.00	
NETHER 2 07/15/24	1,000,000.00	1,039,050.00	
NETHER 2.5 01/15/33	600,000.00	684,354.00	
NETHER 2.75 01/15/47	1,500,000.00	2,026,200.00	
NETHER 3.75 01/15/42	1,300,000.00	1,881,685.00	
NETHER 4 01/15/37	1,400,000.00	1,927,856.00	
NETHER 5.5 01/15/28	700,000.00	885,409.00	
OBL 0 04/05/24	1,300,000.00	1,296,581.00	
OBL 0 04/11/25	2,800,000.00	2,770,264.00	
OBL 0 04/14/23	200,000.00	200,586.00	
OBL 0 10/09/26	1,100,000.00	1,073,424.00	
OBL 0 10/10/25	1,800,000.00	1,773,828.00	
OBL 0 10/13/23	1,600,000.00	1,603,200.00	
OBL 0 10/18/24	600,000.00	595,848.00	
RAGB 0 02/20/30	900,000.00	825,174.00	
RAGB 0 02/20/31	800,000.00	720,160.00	
RAGB 0 07/15/23	600,000.00	601,212.00	
RAGB 0.5 02/20/29	550,000.00	532,020.50	
RAGB 0.5 04/20/27	500,000.00	494,190.00	
RAGB 0.75 02/20/28	700,000.00	696,122.00	
RAGB 0.75 03/20/51	900,000.00	742,626.00	
RAGB 0.75 10/20/26	900,000.00	903,123.00	
RAGB 0.85 06/30/20	150,000.00	87,298.50	
RAGB 1.2 10/20/25	1,000,000.00	1,023,450.00	
RAGB 1.5 02/20/47	700,000.00	709,128.00	
RAGB 1.5 11/02/86	200,000.00	181,060.00	
RAGB 1.65 10/21/24	1,200,000.00	1,241,316.00	
RAGB 1.75 10/20/23	1,000,000.00	1,026,890.00	

RAGB 2.4 05/23/34	600,000.00	671,838.00	
RAGB 3.15 06/20/44	500,000.00	668,505.00	
RAGB 3.8 01/26/62	700,000.00	1,154,867.00	
RAGB 4.15 03/15/37	600,000.00	824,298.00	
RAGB 4.85 03/15/26	500,000.00	583,965.00	
RAGB 6.25 07/15/27	1,000,000.00	1,284,160.00	
RFGB 0.25 09/15/40	300,000.00	241,710.00	
RFGB 0.5 04/15/26	800,000.00	794,160.00	
RFGB 0.5 09/15/28	400,000.00	388,724.00	
RFGB 0.5 09/15/29	800,000.00	769,152.00	
RFGB 0.75 04/15/31	500,000.00	482,310.00	
RFGB 1.375 04/15/47	300,000.00	300,498.00	
RFGB 1.5 04/15/23	200,000.00	203,328.00	
RFGB 2 04/15/24	1,000,000.00	1,036,020.00	
RFGB 2.625 07/04/42	1,000,000.00	1,207,560.00	
RFGB 2.75 07/04/28	400,000.00	444,816.00	
RFGB 4 07/04/25	600,000.00	667,134.00	
SPGB 0 01/31/25	500,000.00	490,655.00	
SPGB 0.25 07/30/24	1,400,000.00	1,392,552.00	
SPGB 0.5 04/30/30	1,000,000.00	924,520.00	
SPGB 0.5 10/31/31	1,400,000.00	1,247,148.00	
SPGB 0.8 07/30/27	400,000.00	391,308.00	
SPGB 1 10/31/50	300,000.00	217,959.00	
SPGB 1.2 10/31/40	700,000.00	594,734.00	
SPGB 1.25 10/31/30	3,000,000.00	2,921,100.00	
SPGB 1.3 10/31/26	3,100,000.00	3,134,100.00	
SPGB 1.4 04/30/28	2,200,000.00	2,213,860.00	
SPGB 1.4 07/30/28	1,600,000.00	1,607,984.00	
SPGB 1.45 04/30/29	2,000,000.00	2,007,860.00	
SPGB 1.45 10/31/27	2,600,000.00	2,627,820.00	
SPGB 1.45 10/31/71	400,000.00	264,032.00	
SPGB 1.5 04/30/27	700,000.00	710,794.00	
SPGB 1.6 04/30/25	1,400,000.00	1,435,896.00	
SPGB 1.85 07/30/35	2,700,000.00	2,658,366.00	
SPGB 1.95 04/30/26	2,000,000.00	2,071,800.00	
SPGB 1.95 07/30/30	1,700,000.00	1,752,649.00	
SPGB 2.15 10/31/25	2,400,000.00	2,503,992.00	
SPGB 2.35 07/30/33	1,500,000.00	1,576,080.00	
SPGB 2.7 10/31/48	1,050,000.00	1,138,851.00	
SPGB 2.75 10/31/24	2,100,000.00	2,214,807.00	
SPGB 2.9 10/31/46	1,700,000.00	1,908,930.00	
SPGB 3.45 07/30/66	1,300,000.00	1,551,043.00	
SPGB 3.8 04/30/24	1,400,000.00	1,495,046.00	
SPGB 4.2 01/31/37	1,250,000.00	1,602,362.50	

	SPGB 4.4 10/31/23	2,000,000.00	2,128,200.00	
	SPGB 4.65 07/30/25	1,800,000.00	2,017,764.00	
	SPGB 4.7 07/30/41	1,500,000.00	2,112,180.00	
	SPGB 4.8 01/31/24	3,000,000.00	3,236,940.00	
	SPGB 4.9 07/30/40	1,200,000.00	1,716,816.00	
	SPGB 5.15 10/31/28	1,500,000.00	1,853,190.00	
	SPGB 5.15 10/31/44	1,000,000.00	1,529,380.00	
	SPGB 5.75 07/30/32	1,500,000.00	2,064,030.00	
	SPGB 5.9 07/30/26	500,000.00	601,445.00	
	SPGB 6 01/31/29	2,200,000.00	2,868,250.00	
	ユーロ小計	393,340,000.00	416,776,296.20 (57,048,339,424)	
国債証券合計			154,868,895,807 (154,868,895,807)	
合計			154,868,895,807 (154,868,895,807)	

(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	48.7%	49.2%
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	5.3%	5.4%
イスラエル・シケル	国債証券	5銘柄	0.4%	0.4%
デンマーク・クローネ	国債証券	6銘柄	0.4%	0.4%
ノルウェー・クローネ	国債証券	7銘柄	0.3%	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・リングギット	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	36.5%	36.8%

#### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

#### ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

##### (1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2021年4月26日現在)	(2022年4月26日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	68,082,064	27,275,290
金銭信託	80,177,155	3,473,575

コール・ローン	183,986,932	175,204,587
国債証券	18,913,583,233	26,250,030,345
派生商品評価勘定	232,914,277	3,271,309
未収入金	214,000,000	2,276,442
未収利息	119,105,342	134,293,222
前払費用	15,533,861	33,807,273
流動資産合計	19,827,382,864	26,629,632,043
資産合計	19,827,382,864	26,629,632,043
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	52,791,964	707,126,924
未払金	316,453,295	12,354,515
未払解約金	23,100,000	1,000,000
未払利息	532	-
その他未払費用	6,007	616
流動負債合計	392,351,798	720,482,055
負債合計	392,351,798	720,482,055
純資産の部		
元本等		
元本	13,008,296,854	18,855,361,405
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	6,426,734,212	7,053,788,583
元本等合計	19,435,031,066	25,909,149,988
純資産合計	19,435,031,066	25,909,149,988
負債純資産合計	19,827,382,864	26,629,632,043

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年4月27日 至 2022年4月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年4月26日現在)	(2022年4月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	13,008,296,854口	18,855,361,405口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.4940円 (1万口当たりの純資産額14,940円)	1口当たり純資産額 1.3741円 (1万口当たりの純資産額13,741円)

## (金融商品に関する注記)

## ・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年4月27日 至 2022年4月26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	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年4月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益	
			うち 1年超			
市場取引 以外の取 引	為替予約取引 買建					
	アメリカ・ドル	139,702,883	-	139,576,890	125,993	
	イギリス・ポ ンド	20,781,467	-	20,693,234	88,233	
	イスラエル・ シュケル	2,242,494	-	2,251,402	8,908	
	オーストラリ ア・ドル	7,091,000	-	7,098,552	7,552	
	カナダ・ドル	6,426,246	-	6,440,953	14,707	
	シンガポール・ ドル	1,735,015	-	1,735,732	717	
	スウェーデン・ クローナ	1,310,073	-	1,313,093	3,020	
	デンマーク・ク ローネ	2,221,625	-	2,232,963	11,338	
	メキシコ・ペソ	2,393,749	-	2,400,916	7,167	
	ユーロ	133,044,305	-	133,680,122	635,817	
	小計	316,948,857	-	317,423,857	475,000	
		売建				
	アメリカ・ドル	8,523,839,369	-	8,320,321,620	203,517,749	
	イギリス・ポ ンド	1,241,773,238	-	1,220,745,305	21,027,933	
	イスラエル・ シュケル	87,079,739	-	87,314,367	234,628	
	オーストラリ ア・ドル	415,566,659	-	415,102,400	464,259	
	カナダ・ドル	383,679,312	-	378,220,441	5,458,871	
	シンガポール・ ドル	174,180,624	-	172,470,480	1,710,144	
	スウェーデン・ クローナ	68,046,060	-	69,111,900	1,065,840	
	デンマーク・ク ローネ	98,247,095	-	98,862,800	615,705	
	ノルウェー・ク ローネ	47,194,021	-	47,523,000	328,979	
	ポーランド・ズ ロチ	124,661,162	-	127,601,080	2,939,918	
	メキシコ・ペソ	152,850,854	-	154,069,344	1,218,490	

	ユーロ	7,849,844,966	-	7,895,973,049	46,128,083
	小計	19,166,963,099	-	18,987,315,786	179,647,313
	合計	19,483,911,956	-	19,304,739,643	180,122,313

(2022年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引 以外の取 引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	12,764,125,201	-	13,303,120,810	538,995,609
	カナダ・ドル	537,103,222	-	549,889,380	12,786,158
	オーストラリ ア・ドル	431,601,589	-	432,161,340	559,751
	シンガポール・ ドル	240,762,153	-	248,075,040	7,312,887
	イギリス・ポン ド	1,432,825,579	-	1,450,035,200	17,209,621
	イスラエル・ シュケル	113,572,262	-	115,075,920	1,503,658
	デンマーク・ク ローネ	109,176,944	-	110,431,800	1,254,856
	ノルウェー・ク ローネ	69,538,844	-	70,023,500	484,656
	スウェーデン・ クローナ	75,018,208	-	75,612,500	594,292
	メキシコ・ペソ	196,132,224	-	201,962,754	5,830,530
	オフショア・人 民元	392,885,374	-	396,512,754	3,627,380
	ポーランド・ズ ロチ	119,218,611	-	120,603,550	1,384,939
	ユーロ	9,924,318,899	-	10,036,630,177	112,311,278
	小計	26,406,279,110	-	27,110,134,725	703,855,615
	合計	26,406,279,110	-	27,110,134,725	703,855,615

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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



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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

自 2021年4月27日 至 2022年4月26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26日現在 )	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	17,571,381,562円
同期中における追加設定元本額	8,582,179,054円
同期中における一部解約元本額	13,145,263,762円
2021年4月26日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	2,096,603,813円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	634,468,070円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	11,763,790円
イオン・バランス戦略ファンド	536,817,606円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,158,343,666円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	418,497,151円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	681,787,045円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	146,325,380円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	29,424,709円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	26,193,219円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,362,970,381円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	810,193円
SMAM・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	5,187,705,209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>	129,547,354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>	319,879,049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>	267,160,219円
合 計	13,008,296,854円

( 2022年4月26日現在 )	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	13,008,296,854円
同期中における追加設定元本額	12,051,443,547円
同期中における一部解約元本額	6,204,378,996円
2022年4月26日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	3,296,843,012円

アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,961,569,030円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	794,172,937円
イオン・バランス戦略ファンド	990,054,894円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,966,334,846円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	743,710,240円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	1,325,826,094円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	322,764,675円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	84,406,317円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	47,175,053円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)	426,749,820円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,263,462,001円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	826,366円
SMAM・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	4,377,678,068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>	379,170,766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>	384,686,299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>	489,930,987円
合計	18,855,361,405円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	T 0.125 01/15/24	600,000.00	574,968.00	
		T 0.125 02/15/24	1,050,000.00	1,004,136.00	
		T 0.125 04/30/23	630,000.00	617,715.00	
		T 0.125 05/15/23	650,000.00	636,694.50	
		T 0.125 06/30/23	320,000.00	312,262.40	
		T 0.125 07/15/23	1,170,000.00	1,140,200.10	
		T 0.125 07/31/23	400,000.00	389,468.00	
		T 0.125 08/15/23	750,000.00	728,902.50	
		T 0.125 09/15/23	570,000.00	552,672.00	
		T 0.125 10/15/23	1,840,000.00	1,779,611.20	
		T 0.25 03/15/24	770,000.00	736,612.80	
		T 0.25 05/15/24	530,000.00	504,613.00	
		T 0.25 05/31/25	370,000.00	341,813.40	
		T 0.25 06/15/24	620,000.00	588,752.00	
		T 0.25 06/30/25	650,000.00	599,111.50	
		T 0.25 08/31/25	1,200,000.00	1,100,712.00	
		T 0.25 09/30/25	290,000.00	265,439.90	
		T 0.25 10/31/25	720,000.00	657,561.60	
		T 0.25 11/15/23	500,000.00	483,515.00	
		T 0.375 01/31/26	1,030,000.00	938,103.40	

T 0.375 04/30/25	320,000.00	297,561.60	
T 0.375 07/31/27	720,000.00	632,808.00	
T 0.375 08/15/24	410,000.00	388,520.10	
T 0.375 09/15/24	700,000.00	661,661.00	
T 0.375 11/30/25	350,000.00	320,250.00	
T 0.375 12/31/25	620,000.00	566,134.40	
T 0.5 02/28/26	1,080,000.00	987,055.20	
T 0.5 03/31/25	420,000.00	392,779.80	
T 0.5 04/30/27	480,000.00	427,233.60	
T 0.5 05/31/27	370,000.00	328,415.70	
T 0.5 06/30/27	1,110,000.00	983,515.50	
T 0.5 08/31/27	640,000.00	564,800.00	
T 0.5 10/31/27	780,000.00	685,542.00	
T 0.5 11/30/23	200,000.00	193,828.00	
T 0.625 03/31/27	520,000.00	466,393.20	
T 0.625 05/15/30	870,000.00	733,035.90	
T 0.625 07/31/26	720,000.00	655,056.00	
T 0.625 08/15/30	1,040,000.00	871,478.40	
T 0.625 10/15/24	230,000.00	218,302.20	
T 0.625 11/30/27	580,000.00	512,528.60	
T 0.625 12/31/27	1,170,000.00	1,031,975.10	
T 0.75 01/31/28	710,000.00	629,180.70	
T 0.75 03/31/26	720,000.00	663,300.00	
T 0.75 08/31/26	710,000.00	648,400.40	
T 0.75 11/15/24	660,000.00	627,125.40	
T 0.75 12/31/23	980,000.00	951,129.20	
T 0.875 01/31/24	900,000.00	873,000.00	
T 0.875 06/30/26	500,000.00	460,760.00	
T 0.875 09/30/26	340,000.00	311,644.00	
T 0.875 11/15/30	1,100,000.00	938,608.00	
T 1 07/31/28	500,000.00	446,050.00	
T 1 12/15/24	600,000.00	572,928.00	
T 1.125 01/15/25	660,000.00	631,144.80	
T 1.125 02/15/31	910,000.00	790,844.60	
T 1.125 02/28/27	280,000.00	258,059.20	
T 1.125 02/29/28	270,000.00	244,474.20	
T 1.125 05/15/40	420,000.00	307,125.00	
T 1.125 08/15/40	380,000.00	276,450.00	
T 1.125 08/31/28	490,000.00	439,926.90	
T 1.125 10/31/26	240,000.00	222,204.00	
T 1.25 03/31/28	660,000.00	601,161.00	
T 1.25 04/30/28	890,000.00	809,686.40	
T 1.25 05/15/50	530,000.00	359,488.40	
T 1.25 05/31/28	580,000.00	526,576.20	

T 1.25 06/30/28	480,000.00	435,446.40	
T 1.25 08/15/31	990,000.00	863,151.30	
T 1.25 08/31/24	450,000.00	434,776.50	
T 1.25 09/30/28	680,000.00	614,597.60	
T 1.25 11/30/26	400,000.00	372,140.00	
T 1.25 12/31/26	730,000.00	678,126.20	
T 1.375 01/31/25	430,000.00	413,771.80	
T 1.375 06/30/23	950,000.00	940,500.00	
T 1.375 08/15/50	680,000.00	476,047.60	
T 1.375 08/31/23	300,000.00	296,250.00	
T 1.375 08/31/26	470,000.00	441,283.00	
T 1.375 10/31/28	180,000.00	163,897.20	
T 1.375 11/15/31	1,420,000.00	1,248,591.80	
T 1.375 11/15/40	800,000.00	607,184.00	
T 1.375 12/31/28	720,000.00	654,804.00	
T 1.5 01/31/27	950,000.00	892,211.50	
T 1.5 02/15/30	550,000.00	499,510.00	
T 1.5 08/15/26	550,000.00	519,123.00	
T 1.5 11/30/24	510,000.00	493,700.40	
T 1.5 11/30/28	680,000.00	623,736.80	
T 1.625 02/15/26	600,000.00	573,234.00	
T 1.625 05/15/26	570,000.00	542,788.20	
T 1.625 05/15/31	1,300,000.00	1,176,396.00	
T 1.625 05/31/23	520,000.00	517,233.60	
T 1.625 08/15/29	510,000.00	469,674.30	
T 1.625 09/30/26	480,000.00	455,323.20	
T 1.625 10/31/23	750,000.00	741,562.50	
T 1.625 11/15/50	870,000.00	650,116.20	
T 1.625 11/30/26	650,000.00	615,413.50	
T 1.75 01/31/29	400,000.00	372,528.00	
T 1.75 05/15/23	700,000.00	697,480.00	
T 1.75 08/15/41	640,000.00	514,144.00	
T 1.75 11/15/29	550,000.00	510,466.00	
T 1.75 12/31/24	390,000.00	379,470.00	
T 1.75 12/31/26	300,000.00	285,375.00	
T 1.875 02/15/32	700,000.00	643,503.00	
T 1.875 02/15/41	630,000.00	521,325.00	
T 1.875 02/15/51	730,000.00	581,262.50	
T 1.875 02/28/27	200,000.00	191,100.00	
T 1.875 02/28/29	850,000.00	798,065.00	
T 1.875 06/30/26	750,000.00	720,847.50	
T 1.875 08/31/24	300,000.00	294,117.00	
T 1.875 11/15/51	670,000.00	533,695.20	
T 2 02/15/25	660,000.00	645,664.80	

T 2 02/15/50	470,000.00	385,508.10	
T 2 04/30/24	200,000.00	197,500.00	
T 2 05/31/24	500,000.00	493,240.00	
T 2 06/30/24	600,000.00	591,234.00	
T 2 08/15/25	600,000.00	584,340.00	
T 2 08/15/51	720,000.00	590,400.00	
T 2 11/15/41	590,000.00	495,092.60	
T 2.125 03/31/24	280,000.00	277,264.40	
T 2.125 05/31/26	320,000.00	310,723.20	
T 2.125 07/31/24	410,000.00	404,776.60	
T 2.25 01/31/24	460,000.00	457,051.40	
T 2.25 02/15/27	450,000.00	437,305.50	
T 2.25 02/15/52	580,000.00	505,910.80	
T 2.25 03/31/26	420,000.00	410,352.60	
T 2.25 04/30/24	770,000.00	764,163.40	
T 2.25 05/15/41	970,000.00	851,854.00	
T 2.25 08/15/27	570,000.00	552,808.80	
T 2.25 08/15/46	250,000.00	214,960.00	
T 2.25 08/15/49	460,000.00	399,983.80	
T 2.25 10/31/24	580,000.00	572,610.80	
T 2.25 11/15/24	500,000.00	493,475.00	
T 2.25 11/15/27	300,000.00	290,388.00	
T 2.25 12/31/23	550,000.00	547,332.50	
T 2.25 12/31/24	500,000.00	492,965.00	
T 2.375 02/15/42	170,000.00	152,228.20	
T 2.375 04/30/26	400,000.00	392,656.00	
T 2.375 05/15/29	330,000.00	319,944.90	
T 2.375 05/15/51	900,000.00	804,582.00	
T 2.375 08/15/24	600,000.00	595,026.00	
T 2.375 11/15/49	520,000.00	465,072.40	
T 2.5 01/31/24	1,000,000.00	997,650.00	
T 2.5 01/31/25	400,000.00	396,888.00	
T 2.5 02/15/45	220,000.00	198,101.20	
T 2.5 02/15/46	150,000.00	135,375.00	
T 2.5 05/15/24	900,000.00	897,390.00	
T 2.5 05/15/46	230,000.00	207,627.90	
T 2.5 08/15/23	300,000.00	300,819.00	
T 2.625 01/31/26	430,000.00	426,237.50	
T 2.625 02/15/29	520,000.00	512,319.60	
T 2.625 03/31/25	500,000.00	497,340.00	
T 2.75 02/15/28	420,000.00	417,110.40	
T 2.75 02/28/25	500,000.00	499,175.00	
T 2.75 06/30/25	200,000.00	199,476.00	
T 2.75 07/31/23	900,000.00	905,409.00	

T 2.75 08/15/47	210,000.00	199,909.50	
T 2.75 08/31/25	600,000.00	598,170.00	
T 2.75 11/15/23	900,000.00	904,005.00	
T 2.75 11/15/42	400,000.00	377,684.00	
T 2.75 11/15/47	250,000.00	237,910.00	
T 2.875 04/30/25	200,000.00	200,296.00	
T 2.875 05/15/28	500,000.00	500,035.00	
T 2.875 05/15/43	290,000.00	278,988.70	
T 2.875 05/15/49	410,000.00	404,362.50	
T 2.875 05/31/25	600,000.00	600,792.00	
T 2.875 08/15/28	660,000.00	660,151.80	
T 2.875 08/15/45	110,000.00	105,925.60	
T 2.875 11/15/46	660,000.00	639,988.80	
T 2.875 11/30/23	900,000.00	905,337.00	
T 2.875 11/30/25	390,000.00	390,362.70	
T 3 02/15/47	120,000.00	119,043.60	
T 3 02/15/48	400,000.00	400,528.00	
T 3 02/15/49	590,000.00	595,481.10	
T 3 05/15/42	290,000.00	286,079.20	
T 3 05/15/45	290,000.00	285,128.00	
T 3 05/15/47	300,000.00	297,984.00	
T 3 08/15/48	350,000.00	350,546.00	
T 3 09/30/25	620,000.00	623,726.20	
T 3 11/15/44	220,000.00	216,079.60	
T 3 11/15/45	300,000.00	295,617.00	
T 3.125 02/15/42	150,000.00	150,937.50	
T 3.125 02/15/43	70,000.00	70,098.00	
T 3.125 05/15/48	420,000.00	431,285.40	
T 3.125 08/15/44	110,000.00	110,128.70	
T 3.125 11/15/28	380,000.00	385,700.00	
T 3.125 11/15/41	210,000.00	211,180.20	
T 3.375 05/15/44	300,000.00	312,420.00	
T 3.375 11/15/48	450,000.00	484,416.00	
T 3.5 02/15/39	180,000.00	193,415.40	
T 3.625 02/15/44	400,000.00	432,812.00	
T 3.625 08/15/43	230,000.00	248,641.50	
T 3.875 08/15/40	120,000.00	134,202.00	
T 4.25 05/15/39	170,000.00	200,001.60	
T 4.25 11/15/40	140,000.00	163,909.20	
T 4.375 02/15/38	40,000.00	47,659.20	
T 4.375 05/15/40	230,000.00	274,454.40	
T 4.375 05/15/41	120,000.00	142,734.00	
T 4.375 11/15/39	300,000.00	357,444.00	
T 4.5 02/15/36	100,000.00	120,328.00	

	T 4.5 08/15/39	120,000.00	145,500.00	
	T 4.625 02/15/40	100,000.00	123,085.00	
	T 5.25 11/15/28	200,000.00	228,374.00	
	T 5.375 02/15/31	80,000.00	95,993.60	
	US TREASURY N/B	980,000.00	937,575.80	
	US TREASURY N/B	520,000.00	494,015.60	
	アメリカ・ドル小計	107,980,000.00	101,172,749.60 (12,909,642,849)	
カナダ・ドル	CAN 0.25 03/01/26	270,000.00	246,169.80	
	CAN 0.25 04/01/24	460,000.00	440,330.40	
	CAN 0.25 08/01/23	300,000.00	292,050.00	
	CAN 0.5 09/01/25	350,000.00	325,734.50	
	CAN 0.5 12/01/30	320,000.00	264,361.60	
	CAN 1 06/01/27	140,000.00	128,956.80	
	CAN 1.25 03/01/25	250,000.00	240,615.00	
	CAN 1.25 06/01/30	420,000.00	374,245.20	
	CAN 1.5 06/01/23	130,000.00	128,789.70	
	CAN 1.5 06/01/26	170,000.00	162,421.40	
	CAN 1.5 06/01/31	360,000.00	322,948.80	
	CAN 1.5 09/01/24	150,000.00	146,392.50	
	CAN 1.5 12/01/31	210,000.00	187,198.20	
	CAN 1.75 12/01/53	260,000.00	203,967.40	
	CAN 2 06/01/28	130,000.00	125,079.50	
	CAN 2 09/01/23	130,000.00	129,290.20	
	CAN 2 12/01/51	370,000.00	312,431.70	
	CAN 2.25 03/01/24	200,000.00	199,044.00	
	CAN 2.25 06/01/25	130,000.00	128,550.50	
	CAN 2.25 06/01/29	150,000.00	145,528.50	
	CAN 2.5 06/01/24	160,000.00	159,814.40	
	CAN 2.75 12/01/48	140,000.00	139,091.40	
	CAN 3.5 12/01/45	90,000.00	100,543.50	
	CAN 4 06/01/41	90,000.00	105,143.40	
CAN 5 06/01/37	70,000.00	88,202.80		
CAN 5.75 06/01/29	90,000.00	107,487.90		
CAN 5.75 06/01/33	60,000.00	76,465.80		
CANADA 2.75 12/01/64	50,000.00	49,065.50		
	カナダ・ドル小計	5,650,000.00	5,329,920.40 (534,111,323)	
オーストラリア・ドル	ACGB 0.25 11/21/24	380,000.00	358,370.40	
	ACGB 0.25 11/21/25	140,000.00	127,891.40	
	ACGB 0.5 09/21/26	150,000.00	135,243.00	
	ACGB 1 11/21/31	250,000.00	206,480.00	
	ACGB 1 12/21/30	230,000.00	193,602.50	
	ACGB 1.25 05/21/32	280,000.00	234,920.00	

	ACGB 1.5 06/21/31	250,000.00	218,235.00	
	ACGB 1.75 06/21/51	110,000.00	74,862.70	
	ACGB 1.75 11/21/32	240,000.00	210,079.20	
	ACGB 2.25 05/21/28	170,000.00	162,936.50	
	ACGB 2.5 05/21/30	300,000.00	287,853.00	
	ACGB 2.75 04/21/24	190,000.00	191,350.90	
	ACGB 2.75 05/21/41	130,000.00	116,989.60	
	ACGB 2.75 06/21/35	110,000.00	104,189.80	
	ACGB 2.75 11/21/27	360,000.00	355,960.80	
	ACGB 2.75 11/21/28	110,000.00	108,212.50	
	ACGB 2.75 11/21/29	180,000.00	176,320.80	
	ACGB 3 03/21/47	120,000.00	109,834.80	
	ACGB 3.25 04/21/25	180,000.00	182,853.00	
	ACGB 3.25 04/21/29	200,000.00	202,692.00	
	ACGB 3.25 06/21/39	100,000.00	98,001.00	
	ACGB 3.75 04/21/37	180,000.00	189,068.40	
	ACGB 4.25 04/21/26	190,000.00	200,068.10	
	ACGB 4.5 04/21/33	180,000.00	202,649.40	
	ACGB 5.5 04/21/23	110,000.00	114,104.10	
	オーストラリア・ドル小計	4,840,000.00	4,562,768.90 (418,725,302)	
シンガ ポール・ ドル	SIGB 1.875 03/01/50	120,000.00	100,320.00	
	SIGB 2 02/01/24	120,000.00	120,081.60	
	SIGB 2.125 06/01/26	510,000.00	507,705.00	
	SIGB 2.25 08/01/36	220,000.00	208,087.00	
	SIGB 2.375 07/01/39	100,000.00	94,900.00	
	SIGB 2.625 05/01/28	230,000.00	232,760.00	
	SIGB 2.75 03/01/46	160,000.00	159,760.00	
	SIGB 2.75 04/01/42	100,000.00	99,846.00	
	SIGB 2.75 07/01/23	200,000.00	202,420.00	
	SIGB 2.875 07/01/29	250,000.00	256,675.00	
	SIGB 2.875 09/01/30	220,000.00	225,940.00	
	SIGB 3 09/01/24	170,000.00	173,706.00	
SIGB 3.375 09/01/33	220,000.00	235,400.00		
	シンガポール・ドル小計	2,620,000.00	2,617,600.60 (243,332,152)	
イギリ ス・ポ ンド	UK TSY GILT	260,000.00	226,668.00	
	UKT 0.125 01/30/26	180,000.00	170,416.80	
	UKT 0.125 01/31/24	360,000.00	350,784.00	
	UKT 0.125 01/31/28	140,000.00	128,252.60	
	UKT 0.25 01/31/25	190,000.00	182,751.50	
	UKT 0.25 07/31/31	250,000.00	216,427.50	
	UKT 0.375 10/22/26	100,000.00	94,384.00	
	UKT 0.375 10/22/30	110,000.00	98,105.70	



UKT 0.5 01/31/29	110,000.00	101,351.80	
UKT 0.5 10/22/61	140,000.00	89,650.40	
UKT 0.625 06/07/25	130,000.00	126,210.50	
UKT 0.625 07/31/35	210,000.00	176,099.70	
UKT 0.625 10/22/50	140,000.00	100,354.80	
UKT 0.875 01/31/46	180,000.00	141,784.20	
UKT 0.875 07/31/33	90,000.00	80,590.50	
UKT 0.875 10/22/29	130,000.00	122,271.50	
UKT 1 01/31/32	90,000.00	83,014.20	
UKT 1 04/22/24	90,000.00	89,025.30	
UKT 1.25 07/22/27	100,000.00	98,130.00	
UKT 1.25 07/31/51	190,000.00	160,622.20	
UKT 1.25 10/22/41	230,000.00	201,337.40	
UKT 1.5 07/22/26	180,000.00	179,188.20	
UKT 1.5 07/22/47	150,000.00	135,765.00	
UKT 1.5 07/31/53	90,000.00	81,612.90	
UKT 1.625 10/22/28	160,000.00	159,745.60	
UKT 1.625 10/22/54	100,000.00	93,486.00	
UKT 1.625 10/22/71	170,000.00	165,675.20	
UKT 1.75 01/22/49	110,000.00	105,240.30	
UKT 1.75 07/22/57	190,000.00	185,392.50	
UKT 1.75 09/07/37	140,000.00	135,006.20	
UKT 2 09/07/25	130,000.00	131,732.90	
UKT 2.25 09/07/23	250,000.00	252,437.50	
UKT 2.5 07/22/65	140,000.00	171,116.40	
UKT 2.75 09/07/24	310,000.00	318,267.70	
UKT 3.25 01/22/44	180,000.00	218,786.40	
UKT 3.5 01/22/45	150,000.00	190,497.00	
UKT 3.5 07/22/68	150,000.00	232,189.50	
UKT 3.75 07/22/52	140,000.00	197,985.20	
UKT 4 01/22/60	110,000.00	175,763.50	
UKT 4.25 03/07/36	180,000.00	229,289.40	
UKT 4.25 06/07/32	140,000.00	170,947.00	
UKT 4.25 09/07/39	140,000.00	186,072.60	
UKT 4.25 12/07/27	130,000.00	147,846.40	
UKT 4.25 12/07/40	140,000.00	188,378.40	
UKT 4.25 12/07/46	160,000.00	229,153.60	
UKT 4.25 12/07/49	90,000.00	133,587.00	
UKT 4.25 12/07/55	120,000.00	190,802.40	
UKT 4.5 09/07/34	150,000.00	191,809.50	
UKT 4.5 12/07/42	230,000.00	326,045.70	
UKT 4.75 12/07/30	160,000.00	198,475.20	
UKT 4.75 12/07/38	70,000.00	97,325.90	
UKT 5 03/07/25	80,000.00	87,407.20	

	UKT 6 12/07/28	100,000.00	126,933.00	
	イギリス・ポンド小計	8,160,000.00	8,672,193.90 (1,410,445,616)	
イスラエル・シユケル	ILGOV 1 03/31/30	150,000.00	135,906.00	
	ILGOV 1.5 05/31/37	360,000.00	304,786.80	
	ILGOV 1.5 11/30/23	780,000.00	782,020.20	
	ILGOV 1.75 08/31/25	330,000.00	329,241.00	
	ILGOV 2.25 09/28/28	270,000.00	270,899.10	
	ILGOV 3.75 03/31/24	120,000.00	124,983.60	
	ILGOV 3.75 03/31/47	290,000.00	323,292.00	
	ILGOV 5.5 01/31/42	70,000.00	97,387.50	
	ILGOV 6.25 10/30/26	450,000.00	532,890.00	
	イスラエル・シユケル小計	2,820,000.00	2,901,406.20 (112,727,175)	
デンマーク・クローネ	DGB 0 11/15/24	510,000.00	503,691.30	
	DGB 0 11/15/31	790,000.00	709,080.30	
	DGB 0.25 11/15/52	500,000.00	368,625.00	
	DGB 0.5 11/15/27	760,000.00	743,591.60	
	DGB 0.5 11/15/29	860,000.00	829,341.00	
	DGB 1.5 11/15/23	440,000.00	450,168.40	
	DGB 1.75 11/15/25	480,000.00	497,889.60	
	DGB 4.5 11/15/39	1,120,000.00	1,692,320.00	
	デンマーク・クローネ小計	5,460,000.00	5,794,707.20 (106,622,612)	
ノルウェー・クローネ	NGB 1.25 09/17/31	230,000.00	202,526.50	
	NGB 1.375 08/19/30	430,000.00	388,019.10	
	NGB 1.5 02/19/26	440,000.00	423,434.00	
	NGB 1.75 02/17/27	510,000.00	490,497.60	
	NGB 1.75 03/13/25	810,000.00	794,213.10	
	NGB 1.75 09/06/29	740,000.00	694,075.60	
	NGB 2 04/26/28	400,000.00	386,064.00	
	NGB 2 05/24/23	700,000.00	702,513.00	
	NGB 2.125 05/18/32	240,000.00	227,736.00	
	NGB 3 03/14/24	620,000.00	629,374.40	
	ノルウェー・クローネ小計	5,120,000.00	4,938,453.30 (69,187,731)	
スウェーデン・クローナ	SGB 0.125 05/12/31	500,000.00	440,960.00	
	SGB 0.75 05/12/28	830,000.00	796,351.80	
	SGB 0.75 11/12/29	630,000.00	596,345.40	
	SGB 1 11/12/26	880,000.00	865,867.20	
	SGB 1.5 11/13/23	990,000.00	999,375.30	
	SGB 2.25 06/01/32	500,000.00	532,895.00	
	SGB 2.5 05/12/25	800,000.00	830,264.00	
	SGB 3.5 03/30/39	430,000.00	544,427.30	

	スウェーデン・クローナ小計	5,560,000.00	5,606,486.00 (73,725,291)	
メキシコ・ペソ	MBONO 10 11/20/36	320,000.00	348,598.40	
	MBONO 10 12/05/24	2,700,000.00	2,759,616.00	
	MBONO 5.75 03/05/26	4,140,000.00	3,704,513.40	
	MBONO 7.5 06/03/27	4,350,000.00	4,101,919.50	
	MBONO 7.75 05/29/31	2,520,000.00	2,343,096.00	
	MBONO 7.75 11/13/42	2,000,000.00	1,766,900.00	
	MBONO 7.75 11/23/34	1,830,000.00	1,670,131.20	
	MBONO 8 09/05/24	2,980,000.00	2,917,360.40	
	MBONO 8 11/07/47	1,860,000.00	1,677,292.20	
	MBONO 8 12/07/23	2,760,000.00	2,724,975.60	
	MBONO 8.5 05/31/29	3,570,000.00	3,499,421.10	
	MBONO 8.5 11/18/38	3,100,000.00	2,990,787.00	
	メキシコ・ペソ小計	32,130,000.00	30,504,610.80 (192,505,447)	
オフショア・人民元	CGB 2.47 09/02/24	2,000,000.00	2,005,560.00	
	CGB 2.56 10/21/23	4,000,000.00	4,023,480.00	
	CGB 2.69 08/12/26	3,000,000.00	3,014,100.00	
	CGB 2.91 10/14/28	5,000,000.00	5,035,300.00	
	CGB 3.02 05/27/31	5,000,000.00	5,057,550.00	
	CGB 3.72 04/12/51	1,000,000.00	1,066,240.00	
	オフショア・人民元小計	20,000,000.00	20,202,230.00 (392,317,205)	
ポーランド・ズロチ	POLGB 0 04/25/23	180,000.00	170,496.00	
	POLGB 0.25 10/25/26	450,000.00	341,550.00	
	POLGB 1.25 10/25/30	230,000.00	158,125.00	
	POLGB 1.75 04/25/32	50,000.00	33,540.00	
	POLGB 2.25 10/25/24	1,230,000.00	1,110,813.00	
	POLGB 2.5 07/25/26	510,000.00	432,862.50	
	POLGB 2.5 07/25/27	180,000.00	148,692.60	
	POLGB 2.75 10/25/29	590,000.00	470,672.50	
	POLGB 3.25 07/25/25	470,000.00	424,128.00	
	POLGB 3.75 05/25/27	680,000.00	596,645.60	
	ポーランド・ズロチ小計	4,570,000.00	3,887,525.20 (114,630,678)	
ユーロ	BGB 0 10/22/27	105,000.00	100,332.75	
	BGB 0 10/22/31	140,000.00	124,073.60	
	BGB 0.1 06/22/30	120,000.00	110,668.80	
	BGB 0.2 10/22/23	80,000.00	80,300.80	
	BGB 0.35 06/22/32	80,000.00	72,307.20	
	BGB 0.4 06/22/40	90,000.00	71,350.20	
	BGB 0.5 10/22/24	90,000.00	90,414.90	
	BGB 0.65 06/22/71	30,000.00	17,832.00	

BGB 0.8 06/22/25	170,000.00	171,696.60	
BGB 0.8 06/22/27	140,000.00	140,040.60	
BGB 0.8 06/22/28	130,000.00	129,331.80	
BGB 0.9 06/22/29	170,000.00	168,784.50	
BGB 1 06/22/26	200,000.00	202,998.00	
BGB 1 06/22/31	160,000.00	157,273.60	
BGB 1.25 04/22/33	100,000.00	99,638.00	
BGB 1.4 06/22/53	60,000.00	53,003.40	
BGB 1.45 06/22/37	60,000.00	58,482.00	
BGB 1.6 06/22/47	140,000.00	133,533.40	
BGB 1.7 06/22/50	100,000.00	96,821.00	
BGB 1.9 06/22/38	90,000.00	93,467.70	
BGB 2.15 06/22/66	130,000.00	139,579.70	
BGB 2.25 06/22/23	100,000.00	102,870.00	
BGB 2.6 06/22/24	240,000.00	252,278.40	
BGB 3 06/22/34	120,000.00	140,623.20	
BGB 3.75 06/22/45	110,000.00	149,965.20	
BGB 4 03/28/32	130,000.00	162,988.80	
BGB 4.25 03/28/41	170,000.00	237,255.40	
BGB 4.5 03/28/26	140,000.00	161,501.20	
BGB 5 03/28/35	210,000.00	295,478.40	
BGB 5.5 03/28/28	210,000.00	267,311.10	
BKO 0 09/15/23	210,000.00	210,380.10	
BTPS	220,000.00	215,311.80	
BTPS 0 01/30/24	240,000.00	237,732.00	
BTPS 0 04/15/24	250,000.00	246,472.50	
BTPS 0 08/01/26	50,000.00	46,727.00	
BTPS 0 11/29/23	190,000.00	188,614.90	
BTPS 0 12/15/24	60,000.00	58,222.20	
BTPS 0.25 03/15/28	100,000.00	90,683.00	
BTPS 0.3 08/15/23	100,000.00	100,246.00	
BTPS 0.35 02/01/25	170,000.00	166,424.90	
BTPS 0.45 02/15/29	290,000.00	259,132.40	
BTPS 0.5 02/01/26	50,000.00	48,298.50	
BTPS 0.5 07/15/28	250,000.00	228,262.50	
BTPS 0.6 08/01/31	370,000.00	312,206.00	
BTPS 0.65 10/15/23	160,000.00	160,865.60	
BTPS 0.85 01/15/27	240,000.00	231,201.60	
BTPS 0.9 04/01/31	170,000.00	148,790.80	
BTPS 0.95 03/01/37	190,000.00	148,692.10	
BTPS 0.95 06/01/32	160,000.00	137,110.40	
BTPS 0.95 08/01/30	180,000.00	161,100.00	
BTPS 0.95 09/15/27	200,000.00	191,368.00	
BTPS 0.95 12/01/31	200,000.00	173,300.00	

BTPS 1.25 12/01/26	360,000.00	354,279.60	
BTPS 1.35 04/01/30	370,000.00	345,398.70	
BTPS 1.45 03/01/36	190,000.00	162,792.00	
BTPS 1.45 05/15/25	240,000.00	241,442.40	
BTPS 1.45 11/15/24	250,000.00	252,097.50	
BTPS 1.5 04/30/45	130,000.00	99,342.10	
BTPS 1.5 06/01/25	410,000.00	413,464.50	
BTPS 1.6 06/01/26	230,000.00	230,828.00	
BTPS 1.65 03/01/32	240,000.00	222,796.80	
BTPS 1.65 12/01/30	210,000.00	197,748.60	
BTPS 1.7 09/01/51	140,000.00	104,959.40	
BTPS 1.8 03/01/41	140,000.00	117,640.60	
BTPS 1.85 05/15/24	330,000.00	337,137.90	
BTPS 2 02/01/28	320,000.00	322,380.80	
BTPS 2 12/01/25	220,000.00	224,727.80	
BTPS 2.05 08/01/27	430,000.00	435,628.70	
BTPS 2.1 07/15/26	250,000.00	255,712.50	
BTPS 2.15 03/01/72	50,000.00	37,843.50	
BTPS 2.15 09/01/52	70,000.00	57,334.90	
BTPS 2.2 06/01/27	180,000.00	184,143.60	
BTPS 2.25 09/01/36	120,000.00	113,487.60	
BTPS 2.45 09/01/33	150,000.00	148,125.00	
BTPS 2.45 09/01/50	150,000.00	133,350.00	
BTPS 2.45 10/01/23	680,000.00	701,590.00	
BTPS 2.5 11/15/25	360,000.00	374,072.40	
BTPS 2.5 12/01/24	130,000.00	134,920.50	
BTPS 2.7 03/01/47	170,000.00	162,834.50	
BTPS 2.8 03/01/67	90,000.00	81,692.10	
BTPS 2.8 12/01/28	120,000.00	125,823.60	
BTPS 2.95 09/01/38	150,000.00	153,013.50	
BTPS 3 08/01/29	350,000.00	369,705.00	
BTPS 3.1 03/01/40	120,000.00	123,970.80	
BTPS 3.25 09/01/46	180,000.00	189,640.80	
BTPS 3.35 03/01/35	110,000.00	117,955.20	
BTPS 3.45 03/01/48	250,000.00	271,220.00	
BTPS 3.5 03/01/30	60,000.00	65,682.60	
BTPS 3.75 09/01/24	150,000.00	159,925.50	
BTPS 3.85 09/01/49	140,000.00	161,575.40	
BTPS 4 02/01/37	250,000.00	288,750.00	
BTPS 4.5 03/01/24	70,000.00	75,041.40	
BTPS 4.5 03/01/26	250,000.00	279,197.50	
BTPS 4.75 08/01/23	300,000.00	317,688.00	
BTPS 4.75 09/01/28	140,000.00	163,052.40	
BTPS 4.75 09/01/44	170,000.00	221,051.00	

BTPS 5 03/01/25	300,000.00	332,712.00	
BTPS 5 08/01/34	380,000.00	476,881.00	
BTPS 5 08/01/39	330,000.00	427,845.00	
BTPS 5 09/01/40	180,000.00	235,130.40	
BTPS 5.25 11/01/29	350,000.00	427,178.50	
BTPS 5.75 02/01/33	200,000.00	261,260.00	
BTPS 6 05/01/31	250,000.00	324,467.50	
BTPS 6.5 11/01/27	190,000.00	237,450.60	
BTPS 9 11/01/23	170,000.00	192,173.10	
DBR 0 02/15/30	210,000.00	198,527.70	
DBR 0 02/15/31	450,000.00	420,651.00	
DBR 0 02/15/32	160,000.00	147,342.40	
DBR 0 05/15/35	200,000.00	176,746.00	
DBR 0 05/15/36	280,000.00	244,168.40	
DBR 0 08/15/26	380,000.00	371,765.40	
DBR 0 08/15/29	250,000.00	237,625.00	
DBR 0 08/15/30	500,000.00	470,135.00	
DBR 0 08/15/31	350,000.00	324,859.50	
DBR 0 08/15/50	230,000.00	175,050.70	
DBR 0 08/15/50	130,000.00	99,602.10	
DBR 0 08/15/52	160,000.00	118,520.00	
DBR 0 11/15/27	400,000.00	386,500.00	
DBR 0 11/15/28	200,000.00	191,418.00	
DBR 0.25 02/15/27	320,000.00	315,590.40	
DBR 0.25 02/15/29	250,000.00	242,870.00	
DBR 0.25 08/15/28	220,000.00	214,328.40	
DBR 0.5 02/15/25	230,000.00	231,173.00	
DBR 0.5 02/15/26	360,000.00	360,446.40	
DBR 0.5 02/15/28	230,000.00	228,074.90	
DBR 0.5 08/15/27	330,000.00	328,188.30	
DBR 1 08/15/24	160,000.00	162,838.40	
DBR 1 08/15/25	430,000.00	438,406.50	
DBR 1.25 08/15/48	280,000.00	299,650.40	
DBR 1.5 05/15/23	400,000.00	407,540.00	
DBR 1.5 05/15/24	390,000.00	400,600.20	
DBR 1.75 02/15/24	320,000.00	329,612.80	
DBR 2 08/15/23	250,000.00	257,307.50	
DBR 2.5 07/04/44	290,000.00	381,892.30	
DBR 2.5 08/15/46	350,000.00	470,995.00	
DBR 3.25 07/04/42	180,000.00	256,732.20	
DBR 4 01/04/37	260,000.00	370,307.60	
DBR 4.25 07/04/39	250,000.00	380,960.00	
DBR 4.75 07/04/28	170,000.00	212,477.90	
DBR 4.75 07/04/34	230,000.00	334,068.10	

DBR 4.75 07/04/40	200,000.00	326,846.00	
DBR 5.5 01/04/31	80,000.00	112,046.40	
DBR 5.625 01/04/28	160,000.00	204,867.20	
DBR 6.25 01/04/30	130,000.00	184,208.70	
DBR 6.5 07/04/27	160,000.00	208,246.40	
FRANCE O.A.T.	80,000.00	59,980.00	
FRTR 0 02/25/24	500,000.00	498,435.00	
FRTR 0 02/25/26	540,000.00	526,213.80	
FRTR 0 02/25/27	350,000.00	336,584.50	
FRTR 0 03/25/24	720,000.00	716,788.80	
FRTR 0 03/25/25	450,000.00	443,304.00	
FRTR 0 05/25/32	180,000.00	157,712.40	
FRTR 0 11/25/29	400,000.00	369,176.00	
FRTR 0 11/25/30	510,000.00	461,565.30	
FRTR 0 11/25/31	450,000.00	398,731.50	
FRTR 0.25 11/25/26	360,000.00	351,712.80	
FRTR 0.5 05/25/25	430,000.00	429,423.80	
FRTR 0.5 05/25/26	640,000.00	634,713.60	
FRTR 0.5 05/25/29	530,000.00	511,598.40	
FRTR 0.5 05/25/40	180,000.00	148,098.60	
FRTR 0.5 05/25/72	80,000.00	44,832.00	
FRTR 0.5 06/25/44	120,000.00	94,034.40	
FRTR 0.75 05/25/28	680,000.00	673,696.40	
FRTR 0.75 05/25/52	350,000.00	267,144.50	
FRTR 0.75 11/25/28	460,000.00	454,070.60	
FRTR 1 05/25/27	360,000.00	363,132.00	
FRTR 1 11/25/25	450,000.00	455,926.50	
FRTR 1.25 05/25/34	430,000.00	420,742.10	
FRTR 1.25 05/25/36	390,000.00	376,346.10	
FRTR 1.5 05/25/31	620,000.00	637,384.80	
FRTR 1.5 05/25/50	330,000.00	312,632.10	
FRTR 1.75 05/25/23	390,000.00	398,193.90	
FRTR 1.75 05/25/66	120,000.00	117,709.20	
FRTR 1.75 06/25/39	300,000.00	310,023.00	
FRTR 1.75 11/25/24	450,000.00	465,142.50	
FRTR 2 05/25/48	280,000.00	296,578.80	
FRTR 2.25 05/25/24	350,000.00	364,192.50	
FRTR 2.5 05/25/30	610,000.00	677,874.70	
FRTR 2.75 10/25/27	530,000.00	584,415.10	
FRTR 3.25 05/25/45	360,000.00	467,283.60	
FRTR 3.5 04/25/26	410,000.00	455,727.30	
FRTR 4 04/25/55	270,000.00	419,164.20	
FRTR 4 04/25/60	170,000.00	272,652.80	
FRTR 4 10/25/38	270,000.00	366,870.60	

FRTR 4.25 10/25/23	340,000.00	361,464.20	
FRTR 4.5 04/25/41	460,000.00	673,835.60	
FRTR 4.75 04/25/35	300,000.00	418,311.00	
FRTR 5.5 04/25/29	390,000.00	510,026.40	
FRTR 5.75 10/25/32	340,000.00	488,722.80	
FRTR 6 10/25/25	180,000.00	213,730.20	
IRISH 0 10/18/31	100,000.00	87,712.00	
IRISH 0.2 05/15/27	120,000.00	116,492.40	
IRISH 0.2 10/18/30	40,000.00	36,709.20	
IRISH 0.9 05/15/28	120,000.00	119,473.20	
IRISH 1 05/15/26	120,000.00	121,566.00	
IRISH 1.1 05/15/29	100,000.00	100,141.00	
IRISH 1.3 05/15/33	90,000.00	88,261.20	
IRISH 1.35 03/18/31	60,000.00	60,689.40	
IRISH 1.5 05/15/50	70,000.00	65,616.60	
IRISH 1.7 05/15/37	100,000.00	101,329.00	
IRISH 2 02/18/45	100,000.00	105,539.00	
IRISH 2.4 05/15/30	100,000.00	109,738.00	
IRISH 3.4 03/18/24	80,000.00	84,775.20	
IRISH 5.4 03/13/25	100,000.00	113,906.00	
IRISH GOVT	50,000.00	40,725.50	
NETHER 0 01/15/24	170,000.00	169,835.10	
NETHER 0 01/15/26	60,000.00	58,661.40	
NETHER 0 01/15/27	140,000.00	135,557.80	
NETHER 0 01/15/29	110,000.00	103,602.40	
NETHER 0 01/15/38	80,000.00	66,003.20	
NETHER 0 01/15/52	130,000.00	92,639.30	
NETHER 0 07/15/30	120,000.00	110,971.20	
NETHER 0 07/15/31	180,000.00	164,138.40	
NETHER 0.25 07/15/25	210,000.00	208,569.90	
NETHER 0.25 07/15/29	130,000.00	124,151.30	
NETHER 0.5 01/15/40	110,000.00	97,879.10	
NETHER 0.5 07/15/26	230,000.00	228,978.80	
NETHER 0.5 07/15/32	100,000.00	94,147.00	
NETHER 0.75 07/15/27	170,000.00	170,171.70	
NETHER 0.75 07/15/28	210,000.00	209,181.00	
NETHER 1.75 07/15/23	160,000.00	163,992.00	
NETHER 2 07/15/24	170,000.00	176,638.50	
NETHER 2.5 01/15/33	140,000.00	159,682.60	
NETHER 2.75 01/15/47	200,000.00	270,160.00	
NETHER 3.75 01/15/42	190,000.00	275,015.50	
NETHER 4 01/15/37	190,000.00	261,637.60	
NETHER 5.5 01/15/28	90,000.00	113,838.30	
OBL 0 04/05/24	410,000.00	408,921.70	



OBL 0 04/10/26	120,000.00	117,708.00	
OBL 0 04/11/25	190,000.00	187,982.20	
OBL 0 04/16/27	30,000.00	29,135.40	
OBL 0 10/09/26	230,000.00	224,443.20	
OBL 0 10/10/25	310,000.00	306,159.10	
OBL 0 10/13/23	350,000.00	350,700.00	
OBL 0 10/18/24	330,000.00	327,716.40	
RAGB 0 02/20/30	120,000.00	110,023.20	
RAGB 0 02/20/31	140,000.00	126,028.00	
RAGB 0 04/20/25	60,000.00	59,141.40	
RAGB 0 07/15/23	180,000.00	180,363.60	
RAGB 0 07/15/24	160,000.00	159,224.00	
RAGB 0 10/20/28	30,000.00	28,129.20	
RAGB 0 10/20/40	50,000.00	37,907.50	
RAGB 0.25 10/20/36	110,000.00	92,634.30	
RAGB 0.5 02/20/29	110,000.00	106,404.10	
RAGB 0.5 04/20/27	200,000.00	197,676.00	
RAGB 0.7 04/20/71	50,000.00	34,059.50	
RAGB 0.75 02/20/28	130,000.00	129,279.80	
RAGB 0.75 03/20/51	80,000.00	66,011.20	
RAGB 0.75 10/20/26	150,000.00	150,520.50	
RAGB 0.9 02/20/32	50,000.00	48,167.50	
RAGB 1.2 10/20/25	140,000.00	143,283.00	
RAGB 1.5 02/20/47	70,000.00	70,912.80	
RAGB 1.5 11/02/86	100,000.00	90,530.00	
RAGB 1.65 10/21/24	80,000.00	82,754.40	
RAGB 1.75 10/20/23	80,000.00	82,151.20	
RAGB 2.4 05/23/34	100,000.00	111,973.00	
RAGB 3.15 06/20/44	100,000.00	133,701.00	
RAGB 3.8 01/26/62	50,000.00	82,490.50	
RAGB 4.15 03/15/37	120,000.00	164,859.60	
RAGB 4.85 03/15/26	100,000.00	116,793.00	
RAGB 6.25 07/15/27	20,000.00	25,683.20	
RFGB 0 09/15/23	60,000.00	60,057.00	
RFGB 0 09/15/24	110,000.00	109,104.60	
RFGB 0 09/15/26	40,000.00	38,651.60	
RFGB 0 09/15/30	70,000.00	63,590.80	
RFGB 0.125 04/15/36	40,000.00	33,501.20	
RFGB 0.125 04/15/52	20,000.00	13,677.60	
RFGB 0.125 09/15/31	70,000.00	63,135.80	
RFGB 0.25 09/15/40	70,000.00	56,399.00	
RFGB 0.5 04/15/26	100,000.00	99,270.00	
RFGB 0.5 04/15/43	60,000.00	49,397.40	
RFGB 0.5 09/15/27	40,000.00	39,332.40	

RFGB 0.5 09/15/29	50,000.00	48,072.00	
RFGB 0.75 04/15/31	30,000.00	28,938.60	
RFGB 0.875 09/15/25	100,000.00	100,975.00	
RFGB 1.125 04/15/34	30,000.00	29,245.80	
RFGB 1.375 04/15/47	50,000.00	50,083.00	
RFGB 1.5 04/15/23	60,000.00	60,998.40	
RFGB 2.625 07/04/42	40,000.00	48,302.40	
RFGB 2.75 07/04/28	100,000.00	111,204.00	
SPGB 0 01/31/25	340,000.00	333,645.40	
SPGB 0 01/31/26	210,000.00	202,169.10	
SPGB 0 01/31/27	210,000.00	198,473.10	
SPGB 0 01/31/28	280,000.00	260,106.00	
SPGB 0 04/30/23	180,000.00	180,352.80	
SPGB 0 05/31/24	230,000.00	227,739.10	
SPGB 0.1 04/30/31	190,000.00	165,157.50	
SPGB 0.25 07/30/24	260,000.00	258,616.80	
SPGB 0.35 07/30/23	190,000.00	190,699.20	
SPGB 0.5 04/30/30	310,000.00	286,601.20	
SPGB 0.5 10/31/31	280,000.00	249,429.60	
SPGB 0.6 10/31/29	220,000.00	206,927.60	
SPGB 0.7 04/30/32	340,000.00	305,156.80	
SPGB 0.8 07/30/27	120,000.00	117,392.40	
SPGB 0.85 07/30/37	120,000.00	100,059.60	
SPGB 1 10/31/50	190,000.00	138,040.70	
SPGB 1.2 10/31/40	240,000.00	203,908.80	
SPGB 1.25 10/31/30	240,000.00	233,688.00	
SPGB 1.3 10/31/26	150,000.00	151,650.00	
SPGB 1.4 04/30/28	280,000.00	281,764.00	
SPGB 1.4 07/30/28	180,000.00	180,898.20	
SPGB 1.45 04/30/29	230,000.00	230,903.90	
SPGB 1.45 10/31/27	180,000.00	181,926.00	
SPGB 1.45 10/31/71	70,000.00	46,205.60	
SPGB 1.5 04/30/27	290,000.00	294,471.80	
SPGB 1.85 07/30/35	280,000.00	275,682.40	
SPGB 1.9 10/31/52	50,000.00	44,074.00	
SPGB 1.95 04/30/26	450,000.00	466,155.00	
SPGB 1.95 07/30/30	210,000.00	216,503.70	
SPGB 2.15 10/31/25	250,000.00	260,832.50	
SPGB 2.35 07/30/33	190,000.00	199,636.80	
SPGB 2.7 10/31/48	160,000.00	173,539.20	
SPGB 2.75 10/31/24	230,000.00	242,574.10	
SPGB 2.9 10/31/46	190,000.00	213,351.00	
SPGB 3.45 07/30/66	170,000.00	202,828.70	
SPGB 3.8 04/30/24	80,000.00	85,431.20	

	SPGB 4.2 01/31/37	230,000.00	294,834.70	
	SPGB 4.4 10/31/23	300,000.00	319,230.00	
	SPGB 4.65 07/30/25	460,000.00	515,650.80	
	SPGB 4.7 07/30/41	200,000.00	281,624.00	
	SPGB 4.8 01/31/24	140,000.00	151,057.20	
	SPGB 4.9 07/30/40	180,000.00	257,522.40	
	SPGB 5.15 10/31/28	380,000.00	469,474.80	
	SPGB 5.15 10/31/44	160,000.00	244,700.80	
	SPGB 5.75 07/30/32	120,000.00	165,122.40	
	SPGB 5.9 07/30/26	110,000.00	132,317.90	
	SPGB 6 01/31/29	160,000.00	208,600.00	
	ユーロ小計	67,835,000.00	70,660,848.65 (9,672,056,963)	
国債証券合計			26,250,030,345 (26,250,030,345)	
合 計			26,250,030,345 (26,250,030,345)	

(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	202銘柄	49.8%	49.2%
カナダ・ドル	国債証券	28銘柄	2.1%	2.0%
オーストラリア・ドル	国債証券	25銘柄	1.6%	1.6%
シンガポール・ドル	国債証券	13銘柄	0.9%	0.9%
イギリス・ポンド	国債証券	53銘柄	5.4%	5.4%
イスラエル・シケル	国債証券	9銘柄	0.4%	0.4%
デンマーク・クローネ	国債証券	8銘柄	0.4%	0.4%
ノルウェー・クローネ	国債証券	10銘柄	0.3%	0.3%
スウェーデン・クローナ	国債証券	8銘柄	0.3%	0.3%
メキシコ・ペソ	国債証券	12銘柄	0.7%	0.7%
オフショア・人民元	国債証券	6銘柄	1.5%	1.5%
ポーランド・ズロチ	国債証券	10銘柄	0.4%	0.4%
ユーロ	国債証券	327銘柄	37.3%	36.8%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

**【中間財務諸表】**

1. 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3、第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期中間計算期間(2022年4月27日から2022年10月26日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

## 【アセットアロケーション・ファンド（安定型）】

## （１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 （2022年 4月26日現在）	第8期中間計算期間 （2022年10月26日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	6,519,262	10,921,977
金銭信託	5,267,383	5,559,745
コール・ローン	265,682,946	150,683,953
投資証券	548,941,349	311,230,521
親投資信託受益証券	8,542,893,732	7,942,384,616
派生商品評価勘定	5,895,945	-
未収入金	-	33,938,066
流動資産合計	9,375,200,617	8,454,718,878
<b>資産合計</b>		
9,375,200,617		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	23,270,080	8,864,130
未払解約金	7,753,468	44,938,691
未払受託者報酬	1,628,047	1,453,960
未払委託者報酬	48,842,701	43,620,148
その他未払費用	326,177	291,136
流動負債合計	81,820,473	99,168,065
<b>負債合計</b>		
81,820,473		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	9,092,669,568	8,673,647,709
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	200,710,576	318,096,896
（分配準備積立金）	888,061,340	836,001,447
元本等合計	9,293,380,144	8,355,550,813
<b>純資産合計</b>		
9,293,380,144		
<b>負債純資産合計</b>		
9,375,200,617		

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第7期中間計算期間 自 2021年 4月27日 至 2021年10月26日	第8期中間計算期間 自 2022年 4月27日 至 2022年10月26日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	20,462,909	15,280,516
受取利息	115	8,980
有価証券売買等損益	174,568,499	486,863,973
為替差損益	1,531,740	1,930,842
営業収益合計	196,563,263	473,505,319
<b>営業費用</b>		
支払利息	92,735	40,650
受託者報酬	1,778,350	1,453,960
委託者報酬	53,350,963	43,620,148
その他費用	477,573	359,106
営業費用合計	55,699,621	45,473,864
営業利益又は営業損失( )	140,863,642	518,979,183
経常利益又は経常損失( )	140,863,642	518,979,183
中間純利益又は中間純損失( )	140,863,642	518,979,183
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	10,466,071	11,687,482
期首剰余金又は期首欠損金( )	709,691,871	200,710,576
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,801,857	270,828
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,801,857	270,828
剰余金減少額又は欠損金増加額	56,900,925	11,786,599
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	56,900,925	11,786,599
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	788,990,374	318,096,896

## ( 3 ) 【中間注記表】

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第8期中間計算期間 自 2022年4月27日 至 2022年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## ( 中間貸借対照表に関する注記 )

項 目	第7期 ( 2022年4月26日現在 )	第8期中間計算期間 ( 2022年10月26日現在 )
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	9,092,669,568口	8,673,647,709口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	元本の欠損 318,096,896円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0221円 ( 1万口当たりの純資産額10,221円 )	1口当たり純資産額 0.9633円 ( 1万口当たりの純資産額9,633円 )

## ( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

該当事項はありません。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第8期中間計算期間 (2022年10月26日現在)	
	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありせん。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（投資証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。	

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 第7期（2022年4月26日現在）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	383,424,516	-	389,063,520	5,639,004
	小計	383,424,516	-	389,063,520	5,639,004
	売建				
	アメリカ・ドル	760,852,301	-	783,865,440	23,013,139
	小計	760,852,301	-	783,865,440	23,013,139
	合計	1,144,276,817	-	1,172,928,960	17,374,135

## 第8期中間計算期間（2022年10月26日現在）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	19,170,163	-	18,920,998	249,165
	小計	19,170,163	-	18,920,998	249,165
	売建				
	アメリカ・ドル	366,177,390	-	374,792,355	8,614,965
	小計	366,177,390	-	374,792,355	8,614,965
	合計	385,347,553	-	393,713,353	8,864,130

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

項目	第7期 (2022年4月26日現在)	第8期中間計算期間 (2022年10月26日現在)
期首元本額	10,377,601,105円	9,092,669,568円
期中追加設定元本額	158,442,458円	117,038,565円
期中一部解約元本額	1,443,373,995円	536,060,424円

## 【アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)】

## ( 1 ) 【中間貸借対照表】

( 単位 : 円 )

	第7期 ( 2022年 4月26日現在 )	第8期中間計算期間 ( 2022年10月26日現在 )
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	7,264,186	13,862,538
金銭信託	4,590,506	6,321,010
コール・ローン	231,541,783	171,316,295
投資証券	847,995,902	412,289,957
親投資信託受益証券	6,369,966,615	6,417,276,538
派生商品評価勘定	5,379,306	-
流動資産合計	7,466,738,298	7,021,066,338
資産合計	7,466,738,298	7,021,066,338
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	30,235,672	14,982,557
未払解約金	12,921,447	372,765
未払受託者報酬	1,282,383	1,182,446
未払委託者報酬	38,472,889	35,474,626
その他未払費用	256,959	236,877
流動負債合計	83,169,350	52,249,271
負債合計	83,169,350	52,249,271
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	6,754,042,056	6,700,785,731
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ( )	629,526,892	268,031,336
( 分配準備積立金 )	1,016,786,295	977,656,789
元本等合計	7,383,568,948	6,968,817,067
純資産合計	7,383,568,948	6,968,817,067
負債純資産合計	7,466,738,298	7,021,066,338

## （ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第7期中間計算期間 自 2021年 4月27日 至 2021年10月26日	第8期中間計算期間 自 2022年 4月27日 至 2022年10月26日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	25,575,563	20,736,757
受取利息	87	12,069
有価証券売買等損益	216,315,605	321,110,865
為替差損益	3,173,539	18,746,885
営業収益合計	245,064,794	319,108,924
<b>営業費用</b>		
支払利息	71,823	38,902
受託者報酬	1,370,641	1,182,446
委託者報酬	41,119,756	35,474,626
その他費用	415,411	329,170
営業費用合計	42,977,631	37,025,144
営業利益又は営業損失（ ）	202,087,163	356,134,068
経常利益又は経常損失（ ）	202,087,163	356,134,068
中間純利益又は中間純損失（ ）	202,087,163	356,134,068
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	13,572,828	4,915,879
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	941,979,619	629,526,892
剰余金増加額又は欠損金減少額	31,256,543	14,169,073
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	31,256,543	14,169,073
剰余金減少額又は欠損金増加額	83,553,389	24,446,440
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	83,553,389	24,446,440
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,078,197,108	268,031,336

## ( 3 ) 【中間注記表】

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第8期中間計算期間 自 2022年4月27日 至 2022年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## ( 中間貸借対照表に関する注記 )

項 目	第7期 ( 2022年4月26日現在 )	第8期中間計算期間 ( 2022年10月26日現在 )
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	6,754,042,056口	6,700,785,731口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0932円 ( 1万口当たりの純資産額10,932円 )	1口当たり純資産額 1.0400円 ( 1万口当たりの純資産額10,400円 )

## ( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 金融商品に関する注記 )

## 金融商品の時価等に関する事項

項 目	第8期中間計算期間 ( 2022年10月26日現在 )

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

第7期(2022年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	359,140,754	-	364,324,640	5,183,886
	小計	359,140,754	-	364,324,640	5,183,886
	売建				
	アメリカ・ドル	993,180,228	-	1,023,220,480	30,040,252
	小計	993,180,228	-	1,023,220,480	30,040,252
合 計		1,352,320,982	-	1,387,545,120	24,856,366

第8期中間計算期間(2022年10月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	21,067,049	-	20,990,482	76,567
	小計	21,067,049	-	20,990,482	76,567
	売建				
	アメリカ・ドル	619,095,276	-	634,001,266	14,905,990
	小計	619,095,276	-	634,001,266	14,905,990
合 計		640,162,325	-	654,991,748	14,982,557

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

項目	第7期 (2022年4月26日現在)	第8期中間計算期間 (2022年10月26日現在)
期首元本額	7,473,130,169円	6,754,042,056円
期中追加設定元本額	430,295,633円	209,590,414円
期中一部解約元本額	1,149,383,746円	262,846,739円

## 【アセットアロケーション・ファンド(成長型)】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第7期 (2022年 4月26日現在)	第8期中間計算期間 (2022年10月26日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	4,860,644	9,319,965
金銭信託	2,166,589	2,511,075
コール・ローン	109,281,183	68,056,838
投資証券	573,295,985	256,712,232
親投資信託受益証券	3,227,244,365	3,322,618,078
派生商品評価勘定	3,427,731	-
未収入金	13,877,636	-
流動資産合計	3,934,154,133	3,659,218,188
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	20,302,332	10,390,886
未払解約金	16,630,402	300,000
未払受託者報酬	674,070	620,305
未払委託者報酬	20,223,281	18,610,608
その他未払費用	135,057	124,190
流動負債合計	57,965,142	30,045,989
負債合計	57,965,142	30,045,989
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,430,668,866	3,353,792,367
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	445,520,125	275,379,832
(分配準備積立金)	646,745,627	616,561,376
元本等合計	3,876,188,991	3,629,172,199
純資産合計	3,876,188,991	3,629,172,199
負債純資産合計	3,934,154,133	3,659,218,188

## （ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第7期中間計算期間 自 2021年 4月27日 至 2021年10月26日	第8期中間計算期間 自 2022年 4月27日 至 2022年10月26日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	16,514,072	14,005,164
受取利息	51	8,161
有価証券売買等損益	142,448,866	143,954,377
為替差損益	4,361,705	12,734,876
営業収益合計	163,324,694	142,675,928
<b>営業費用</b>		
支払利息	38,737	19,402
受託者報酬	730,837	620,305
委託者報酬	21,925,405	18,610,608
その他費用	235,142	188,856
営業費用合計	22,930,121	19,439,171
営業利益又は営業損失（ ）	140,394,573	162,115,099
経常利益又は経常損失（ ）	140,394,573	162,115,099
中間純利益又は中間純損失（ ）	140,394,573	162,115,099
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	8,021,137	3,793,483
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	591,057,132	445,520,125
剰余金増加額又は欠損金減少額	17,397,140	9,186,944
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	17,397,140	9,186,944
剰余金減少額又は欠損金増加額	48,628,601	21,005,621
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	48,628,601	21,005,621
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	692,199,107	275,379,832



## ( 3 ) 【中間注記表】

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第8期中間計算期間 自 2022年4月27日 至 2022年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## ( 中間貸借対照表に関する注記 )

項 目	第7期 ( 2022年4月26日現在 )	第8期中間計算期間 ( 2022年10月26日現在 )
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	3,430,668,866口	3,353,792,367口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1299円 ( 1万口当たりの純資産額11,299円 )	1口当たり純資産額 1.0821円 ( 1万口当たりの純資産額10,821円 )

## ( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( 金融商品に関する注記 )

## 金融商品の時価等に関する事項

項 目	第8期中間計算期間 ( 2022年10月26日現在 )

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

第7期(2022年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	227,552,385	-	230,811,200	3,258,815
	小計	227,552,385	-	230,811,200	3,258,815
	売建				
	アメリカ・ドル	680,056,500	-	700,189,916	20,133,416
	小計	680,056,500	-	700,189,916	20,133,416
合計		907,608,885	-	931,001,116	16,874,601

第8期中間計算期間(2022年10月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	24,401,836	-	24,242,528	159,308
	小計	24,401,836	-	24,242,528	159,308
	売建				
	アメリカ・ドル	424,951,385	-	435,182,963	10,231,578
	小計	424,951,385	-	435,182,963	10,231,578
合計		449,353,221	-	459,425,491	10,390,886

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

項目	第7期 (2022年4月26日現在)	第8期中間計算期間 (2022年10月26日現在)
期首元本額	3,829,011,023円	3,430,668,866円
期中追加設定元本額	172,858,285円	85,115,571円
期中一部解約元本額	571,200,442円	161,992,070円

(参考)

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

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

(1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2022年4月26日現在)	(2022年10月26日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	38,460,616	112,207,820
コール・ローン	1,939,925,432	3,041,132,190
株式	196,699,150,170	209,867,541,580
派生商品評価勘定	10,660,800	123,563,200
未収配当金	2,368,445,415	2,176,109,239
前払金	120,890,000	-
差入委託証拠金	183,300,000	237,600,000
流動資産合計	201,360,832,433	215,558,154,029
資産合計	201,360,832,433	215,558,154,029

負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	123,711,500	1,100
前受金	-	95,080,000
未払解約金	95,194,113	22,401,978
その他未払費用	4,482	8,585
流動負債合計	218,910,095	117,491,663
負債合計	218,910,095	117,491,663
純資産の部		
元本等		
元本	63,261,805,196	65,470,662,579
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	137,880,117,142	149,969,999,787
元本等合計	201,141,922,338	215,440,662,366
純資産合計	201,141,922,338	215,440,662,366
負債純資産合計	201,360,832,433	215,558,154,029

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2022年4月27日 至 2022年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	( 2022年4月26日現在 )	( 2022年10月26日現在 )
-----	------------------	-------------------

1. 当計算期間の末日における 受益権の総数	63,261,805,196口	65,470,662,579口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.1795円 (1万口当たりの純資産額31,795円)	1口当たり純資産額 3.2906円 (1万口当たりの純資産額32,906円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年10月26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)

(2022年4月26日現在)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物 0406月	4,559,170,700	-	4,446,120,000	113,050,700
	小計	4,559,170,700	-	4,446,120,000	113,050,700
合計		4,559,170,700	-	4,446,120,000	113,050,700

(2022年10月26日現在)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物 0412月	5,420,902,900	-	5,544,465,000	123,562,100
	小計	5,420,902,900	-	5,544,465,000	123,562,100
合計		5,420,902,900	-	5,544,465,000	123,562,100

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1)原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(2022年4月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	60,391,040,010円
同期中における追加設定元本額	11,694,994,809円
同期中における一部解約元本額	8,824,229,623円
2022年4月26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	9,498,830,729円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	981,562,776円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,546,847,970円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,448,440,778円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	129,139,788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)	20,168,646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)	63,518,648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)	153,838,056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)	245,294,698円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,502,049,659円
三井住友・DCつみたてN I S A・日本株インデックスファンド	19,696,465,018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D S・DCターゲットイヤーファンド2050	32,080,235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)	166,474,648円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	591,913,486円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	322,705,825円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	368,867,306円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	41,699,673円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	551,666,449円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	17,990,681円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	90,470,993円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	95,218,221円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	4,109,911円
日興F W S・日本株インデックス	592,212,994円
三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド	5,338,179円
S M A M・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,749,396,476円
バランスファンドV A(安定運用型) <適格機関投資家限定>	18,579,823円
S M A M・バランスファンドV A安定成長型 <適格機関投資家限定>	97,797,524円

S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	1,766,376,348円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >	1,639,438,827円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	6,218,766,294円
S M A M ・ バランスファンドV L 3 0 < 適格機関投資家限定 >	40,740,210円
S M A M ・ バランスファンドV L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	159,471,500円
S M A M ・ バランスファンドV A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	740,333,728円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	46,826,720円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	257,810,451円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	839,187,037円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	607,019,790円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	1,875,496,934円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	374,931円
S M A M ・ グローバルバランス 4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	42,725,221円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	47,564,568円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	34,436,924円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	16,874,370円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	113,224,715円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	245,176,007円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	60,459,399円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	41,090,482円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	7,630,596円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 0 L 2 < 適格機関投資家専用 >	44,249,093円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	601,112,754円
S M A M ・ 国内株式インデックスファンド・ V A ( 適格機関投資家専用 )	181,398,201円
S M A M ・ グローバルバランスファンド ( 標準型 ) V A < 適格機関投資家限定 >	222,266,350円
S M A M ・ グローバルバランスファンド ( 債券重視型 ) V A < 適格機関投資家限定 >	101,339,489円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	181,801,332円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	55,617,287円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	43,072,081円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	28,371,625円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	36,568,156円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	67,859,289円
S M D A M ・ 日米 3 資産バランスオープン < 適格機関投資家限定 >	12,284,348円
合 計	63,261,805,196円

( 2022年10月26日現在 )

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	63,261,805,196円
同期中における追加設定元本額	5,616,273,962円
同期中における一部解約元本額	3,407,416,579円
2022年10月26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	9,580,266,602円
三井住友・D C 年金バランス 3 0 ( 債券重点型 )	1,050,007,924円
三井住友・D C 年金バランス 5 0 ( 標準型 )	4,672,736,855円
三井住友・D C 年金バランス 7 0 ( 株式重点型 )	3,596,318,256円
S M A M ・ グローバルバランスファンド ( 機動的資産配分型 )	150,037,258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)	4,359,754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)	20,004,779円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	65,293,120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)	168,369,176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)	152,307,266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)	268,485,068円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,457,257,870円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	21,677,266,937円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	131,058,857円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	212,157,060円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	139,804,903円
イオン・バランス戦略ファンド	17,323,270円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	41,453,785円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	193,448,963円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	182,373,462円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	663,533,066円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	374,564,286円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	420,692,888円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	48,951,021円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	787,521,968円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	40,384,760円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	198,866,698円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	188,535,434円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	5,557,988円
日興FWS・日本株インデックス	1,151,283,374円
三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド	17,449,384円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,625,333,149円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	11,118,882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>	79,456,538円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	1,568,758,365円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	1,537,357,333円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	5,780,742,001円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	38,205,939円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	144,473,228円
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	690,730,627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>	46,213,392円
SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	254,234,553円
SMAM・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>	796,235,497円
SMAM・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>	555,095,596円
SMAM・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>	1,729,215,024円
SMAM・バランスVA株40T <適格機関投資家限定>	372,784円
SMAM・グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	37,699,412円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	42,742,672円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用>	32,479,210円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用>	16,795,425円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用>	101,576,520円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用>	230,092,385円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2 <適格機関投資家専用>	54,297,783円



SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	38,723,328円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	7,737,301円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	41,917,771円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	561,580,290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)	171,790,446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>	211,396,741円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	90,728,678円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	106,179,117円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	47,780,927円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	45,934,025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>	9,786,781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>	12,298,327円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	55,774,152円
SMDAM・日米3資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	18,136,348円
合計	65,470,662,579円

## 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)

	(2022年4月26日現在)	(2022年10月26日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
預金	3,823,150,343	7,636,703,217
金銭信託	3,335,998	16,592,018
コール・ローン	168,265,306	449,688,100
株式	367,861,655,320	412,281,935,808
投資証券	10,140,612,029	9,781,088,705
派生商品評価勘定	23,850,169	362,654,936
未収入金	9,336,624	59,787,408
未収配当金	411,028,428	317,902,556
差入委託証拠金	1,745,293,514	4,988,367,207
流動資産合計	384,186,527,731	435,894,719,955
資産合計	384,186,527,731	435,894,719,955
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
派生商品評価勘定	134,319,687	344,565,383
未払解約金	600,406,328	168,009,316
その他未払費用	1,452	3,080
流動負債合計	734,727,467	512,577,779
負債合計	734,727,467	512,577,779
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	63,556,720,108	69,732,672,270
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	319,895,080,156	365,649,469,906

元本等合計	383,451,800,264	435,382,142,176
純資産合計	383,451,800,264	435,382,142,176
負債純資産合計	384,186,527,731	435,894,719,955

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年4月27日 至 2022年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年4月26日現在)	(2022年10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	63,556,720,108口	69,732,672,270口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 6.0332円 (1万口当たりの純資産額60,332円)	1口当たり純資産額 6.2436円 (1万口当たりの純資産額62,436円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年10月26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)

(2022年4月26日現在)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	S&P 500 EMINI FUT JUN22	4,122,572,256	-	4,025,998,515	96,573,741
	SP1 200 FUTURES JUN22	205,615,274	-	201,609,513	4,005,761
	FTSE 100 IDX FUT JUN22	241,938,385	-	239,617,512	2,320,873
	EURO STOXX 50 JUN22	756,038,201	-	741,472,116	14,566,085
	小計	5,326,164,116	-	5,208,697,656	117,466,460
	合計	5,326,164,116	-	5,208,697,656	117,466,460

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
為替予約取引	買建				
	スウェーデン・ク ローナ	135,101	-	131,500	3,601
	小計	135,101	-	131,500	3,601
	売建				
	アメリカ・ドル	448,816,113	-	446,564,421	2,251,692
	カナダ・ドル	25,292,154	-	25,049,920	242,234
	オーストラリア・ド ル	13,173,611	-	12,847,550	326,061

市場取引以 外の取引	香港・ドル	6,537,970	-	6,503,796	34,174
	シンガポール・ドル	3,743,098	-	3,718,220	24,878
	ニュージーランド・ ドル	863,930	-	845,570	18,360
	イギリス・ポンド	42,843,978	-	42,284,300	559,678
	イスラエル・シケ ル	1,570,470	-	1,554,316	16,154
	スイス・フラン	45,708,002	-	45,326,920	381,082
	デンマーク・クロー ネ	5,753,758	-	5,704,369	49,389
	ノルウェー・クロー ネ	3,111,615	-	3,081,875	29,740
	スウェーデン・ク ローナ	6,680,540	-	6,575,000	105,540
	ユーロ	168,588,696	-	165,627,135	2,961,561
	小計	772,683,935	-	765,683,392	7,000,543
	合 計	772,819,036	-	765,814,892	6,996,942

(2022年10月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	S&P 500 EMINI FUT DEC22	10,319,642,899	-	10,297,684,477	21,958,422
	SPI 200 FUTURES DEC22	463,231,314	-	465,386,142	2,154,828
	FTSE 100 IDX FUT DEC22	570,405,134	-	559,393,962	11,011,172
	EURO STOXX 50 DEC22	1,772,216,935	-	1,821,568,536	49,351,601
	小計	13,125,496,282	-	13,144,033,117	18,536,835
	合 計	13,125,496,282	-	13,144,033,117	18,536,835

(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)

		契 約 額 等		

区分	種類		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	227,501,622	-	226,323,083	1,178,539
	カナダ・ドル	22,776,861	-	22,713,681	63,180
	イギリス・ポンド	24,295,060	-	24,406,776	111,716
	スイス・フラン	24,614,023	-	24,553,254	60,769
	ユーロ	52,189,866	-	52,161,581	28,285
	小計	351,377,432	-	350,158,375	1,219,057
	売建				
	アメリカ・ドル	266,297,873	-	265,531,790	766,083
	ユーロ	67,631,400	-	67,625,709	5,691
	小計	333,929,273	-	333,157,499	771,774
合計		685,306,705	-	683,315,874	447,283

## (注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (その他の注記)

(2022年4月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	57,943,987,779円
同期中における追加設定元本額	15,824,942,750円
同期中における一部解約元本額	10,212,210,421円
2022年4月26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	32,824,989,661円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	257,317,370円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,047,578,763円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	747,973,617円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	60,989,172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)	5,363,638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)	16,244,720円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	43,713,957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)	47,361,014円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	93,028,840円
外国株式指数ファンド	854,964,510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	14,459,619,207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)	120,600,881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)	193,274,372円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	223,259,235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	772,040,864円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	4,693,304円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	20,205,997円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	19,677,700円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,976,165円
SMB C・DCインデックスファンド(M S C Iコクサイ)	178,127,088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)	556,407,030円
三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド	20,929,896円
S M A M・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	502,987,590円
バランスファンドV A(安定運用型) <適格機関投資家限定>	4,946,844円
S M A M・バランスファンドV A安定成長型 <適格機関投資家限定>	25,733,245円
S M A M・バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	622,840,510円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	760,966,204円
S M A M・バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	3,294,948,550円
S M A M・バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	10,889,499円
S M A M・バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定>	56,580,424円
S M A M・バランスファンドV A 7 5 <適格機関投資家専用>	444,174,100円
S M A M・バランスファンドV L 国際分散型 <適格機関投資家限定>	37,545,497円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5 <適格機関投資家専用>	93,355,655円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0 <適格機関投資家専用>	445,662,014円
S M A M・バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用>	324,389,117円
S M A M・バランスファンドV A 3 5 <適格機関投資家専用>	750,605,330円
S M A M・バランスV A株4 0 T <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・V A S(適格機関投資家専用)	208,063,748円
S M A M・グローバルバランス4 0 V A <適格機関投資家限定>	67,237,428円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A <適格機関投資家専用>	8,668,847円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A <適格機関投資家専用>	7,431,222円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A <適格機関投資家専用>	3,930,927円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 L <適格機関投資家専用>	20,254,181円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L <適格機関投資家専用>	55,967,394円
S M A M・グローバルバランスファンド(標準型) V A <適格機関投資家限定>	114,373,759円

S M A M ・ グローバルバランスファンド(債券重視型) V A < 適格機関投資家限定 >	52,566,720円
S M A M ・ 世界バランスファンド V A < 適格機関投資家限定 >	494,019,000円
S M A M ・ 世界バランスファンド V A 2 < 適格機関投資家限定 >	93,680,381円
S M A M ・ 外国株式インデックスファンド S A < 適格機関投資家限定 >	1,402,985,029円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	22,195,395円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	14,310,453円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	18,636,428円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	62,157,282円
合 計	63,556,720,108円

(2022年10月26日現在)

## 開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	63,556,720,108円
同期中における追加設定元本額	11,958,200,792円
同期中における一部解約元本額	5,782,248,630円

## 2022年10月26日現在の元本の内訳

三井住友・D C 外国株式インデックスファンド S	35,825,934,401円
三井住友・D C 年金バランス 3 0 (債券重点型)	287,530,813円
三井住友・D C 年金バランス 5 0 (標準型)	1,093,848,381円
三井住友・D C 年金バランス 7 0 (株式重点型)	789,614,147円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	34,121,330円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 2 0 (4資産タイプ)	1,017,107円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 2 5 (4資産タイプ)	5,342,658円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 3 0 (4資産タイプ)	17,205,184円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 3 5 (4資産タイプ)	50,367,711円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 4 0 (4資産タイプ)	56,150,969円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 4 5 (4資産タイプ)	104,929,884円
外国株式指数ファンド	931,698,417円
三井住友・D C つみたて N I S A ・ 全海外株インデックスファンド	17,166,037,592円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	87,097,013円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	97,508,641円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	63,989,360円
イオン・バランス戦略ファンド	11,536,520円
三井住友 D S ・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 5 0	20,762,285円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	133,680,541円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	118,683,333円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	434,936,484円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	233,446,042円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	267,224,366円
三井住友・D C つみたて N I S A ・ 世界分散ファンド	54,384,063円
三井住友 D S ・ 外国株式インデックス年金ファンド	1,376,037,106円
三井住友 D S ・ 年金バランス 3 0 (債券重点型)	11,161,705円
三井住友 D S ・ 年金バランス 5 0 (標準型)	47,225,708円
三井住友 D S ・ 年金バランス 7 0 (株式重点型)	41,466,375円
三井住友 D S ・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 6 0	2,682,341円
S M B C ・ D C インデックスファンド(M S C I コクサイ)	360,342,837円

日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	189,202,921円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	1,353,566,727円
三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド	48,123,257円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	463,221,631円
バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	2,845,306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 >	21,307,587円
SMAM・バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 >	564,605,854円
SMAM・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	726,928,339円
SMAM・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	3,129,347,782円
SMAM・バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 >	10,511,330円
SMAM・バランスファンドVL50 < 適格機関投資家限定 >	51,791,476円
SMAM・バランスファンドVA75 < 適格機関投資家専用 >	423,311,736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 >	37,322,232円
SMAM・インデックス・バランスVA25 < 適格機関投資家専用 >	90,939,599円
SMAM・インデックス・バランスVA50 < 適格機関投資家専用 >	440,033,918円
SMAM・バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 >	300,547,776円
SMAM・バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 >	701,933,054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)	197,257,005円
SMAM・グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	60,711,309円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 >	7,485,469円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A < 適格機関投資家専用 >	6,951,628円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A < 適格機関投資家専用 >	3,833,026円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L < 適格機関投資家専用 >	17,763,907円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 >	52,669,412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 >	113,544,613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 >	49,498,800円
SMAM・世界バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 >	301,671,299円
SMAM・世界バランスファンドVA2 < 適格機関投資家限定 >	80,381,144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 >	493,086,534円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	15,751,862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 >	2,926,588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 >	3,364,789円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	44,070,821円
合計	69,732,672,270円

## エマージング株式インデックス・マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2022年4月26日現在)	(2022年10月26日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	1,420,250,939	2,962,313,781
金銭信託	35,129,306	3,647,533
コール・ローン	1,771,896,597	98,857,914
株式	13,549,402,847	17,186,867,483



投資信託受益証券	752,699,820	1,052,648,695
投資証券	1,401,586,708	1,986,029,794
派生商品評価勘定	245,941,843	114,406
未収入金	121,741	2,900,401
未収配当金	31,232,619	18,775,919
差入委託証拠金	844,604,732	1,041,883,797
流動資産合計	20,052,867,152	24,354,039,723
資産合計	20,052,867,152	24,354,039,723
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	62,722,219	406,824,647
未払解約金	22,441,148	89,663,880
その他未払費用	4,032	602
流動負債合計	85,167,399	496,489,129
負債合計	85,167,399	496,489,129
純資産の部		
元本等		
元本	12,191,357,761	15,308,868,869
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	7,776,341,992	8,548,681,725
元本等合計	19,967,699,753	23,857,550,594
純資産合計	19,967,699,753	23,857,550,594
負債純資産合計	20,052,867,152	24,354,039,723

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2022年4月27日 至 2022年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資信託受益証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

2. デリバティブの評価基準及び評価方法	(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。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年4月26日現在)	(2022年10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	12,191,357,761口	15,308,868,869口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.6379円 (1万口当たりの純資産額16,379円)	1口当たり純資産額 1.5584円 (1万口当たりの純資産額15,584円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年10月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（株式、投資信託受益証券、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

(2022年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MSCI EMGMKT JUN22	4,275,648,872	-	4,259,752,464	15,896,408
	小計	4,275,648,872	-	4,259,752,464	15,896,408

合計	4,275,648,872	-	4,259,752,464	15,896,408
----	---------------	---	---------------	------------

(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	2,737,900,000	-	2,974,595,381	236,695,381
	小計	2,737,900,000	-	2,974,595,381	236,695,381
	売建				
	アメリカ・ドル	952,000,000	-	989,579,349	37,579,349
	小計	952,000,000	-	989,579,349	37,579,349
合計		3,689,900,000	-	3,964,174,730	199,116,032

(2022年10月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建				
	MSCI EMGMKT DEC22	4,028,101,334	-	3,621,276,688	406,824,646
	小計	4,028,101,334	-	3,621,276,688	406,824,646
合計		4,028,101,334	-	3,621,276,688	406,824,646

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1) 原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	アメリカ・ドル	39,300,000	-	39,185,594	114,406
	小計	39,300,000	-	39,185,594	114,406
合計		39,300,000	-	39,185,594	114,406

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

(その他の注記)

(2022年4月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	8,325,755,557円
同期中における追加設定元本額	6,016,733,591円
同期中における一部解約元本額	2,151,131,387円
2022年4月26日現在の元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	6,746,739,785円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	2,714,636,324円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	44,385,580円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	237,701,767円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	157,541,199円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	28,182,083円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	90,118,390円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	65,071,224円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	259,245,317円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	214,464,764円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	348,547,103円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	78,602,899円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	3,563,961円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	430,155,490円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	711,584,443円
三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド	5,814,304円
SMA M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	55,003,128円
合計	12,191,357,761円

(2022年10月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	12,191,357,761円
同期中における追加設定元本額	3,910,292,137円
同期中における一部解約元本額	792,781,029円
2022年10月26日現在の元本の内訳	

三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	8,225,695,149円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	2,921,440,582円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	47,719,466円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	236,594,721円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	155,000,946円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	38,084,073円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	94,365,741円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	72,728,952円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	325,063,762円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	262,510,820円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	427,523,460円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	98,771,269円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	5,011,473円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	556,749,959円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	1,759,319,487円
三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド	17,781,569円
S M A M ・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	64,507,440円
合計	15,308,868,869円

## Jリート・インデックス・マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2022年4月26日現在)	(2022年10月26日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	960,122	3,447,274
コール・ローン	48,427,834	93,430,348
投資証券	8,247,387,550	9,732,607,800
派生商品評価勘定	2,395,600	-
未収配当金	69,756,673	77,251,755
前払金	-	2,872,000
差入委託証拠金	2,330,000	2,180,000
流動資産合計	8,371,257,779	9,911,789,177
資産合計	8,371,257,779	9,911,789,177
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	1,586,400
前受金	2,440,000	-
未払金	-	47,859,765
未払解約金	2,949,776	8,260,271
その他未払費用	169	230
流動負債合計	5,389,945	57,706,666
負債合計	5,389,945	57,706,666
純資産の部		
元本等		
元本	3,142,280,407	3,728,143,699

剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	5,223,587,427	6,125,938,812
元本等合計	8,365,867,834	9,854,082,511
純資産合計	8,365,867,834	9,854,082,511
負債純資産合計	8,371,257,779	9,911,789,177

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2022年4月27日 至 2022年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	( 2022年4月26日現在 )	( 2022年10月26日現在 )
1. 当計算期間の末日における 受益権の総数	3,142,280,407口	3,728,143,699口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.6624円 ( 1万口当たりの純資産額26,624円 )	1口当たり純資産額 2.6432円 ( 1万口当たりの純資産額26,432円 )

## ( 金融商品に関する注記 )

## 金融商品の時価等に関する事項

項 目	( 2022年10月26日現在 )
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(2022年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	リート指数先物取引 買建				
	TREIT 先物 0406月	37,204,400	-	39,600,000	2,395,600
	小計	37,204,400	-	39,600,000	2,395,600
合計		37,204,400	-	39,600,000	2,395,600

(2022年10月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	リート指数先物取引 買建				
	TREIT 先物 0412月	40,146,400	-	38,560,000	1,586,400
	小計	40,146,400	-	38,560,000	1,586,400
合計		40,146,400	-	38,560,000	1,586,400

(注) 1. 時価の算定方法

リート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) リート指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(2022年4月26日現在)

開示対象ファンドの 期首における当該親投資信託の元本額	3,071,522,148円
--------------------------------	----------------

同期中における追加設定元本額	2,198,779,564円
同期中における一部解約元本額	2,128,021,305円
2022年4月26日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	74,332,453円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	144,802,192円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	113,294,756円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	1,953,407,139円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	13,792,150円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	55,523,511円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	40,771,712円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	135,968,837円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	74,606,058円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	58,817,013円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	24,699,702円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	1,673,254円
三井住友D S・国内リートインデックス年金ファンド	58,102,181円
日興F W S・Jリートインデックス	181,297,356円
三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド	1,894,768円
S M A M・世界リート・インデックスファンドV A <適格機関投資家限定>	3,536,609円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	47,867,823円
S M A M・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	32,115,891円
S M A M・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	40,704,739円
S M D A M・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%)<適格機関投資家限定>	85,072,263円
合計	3,142,280,407円

(2022年10月26日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	3,142,280,407円
同期中における追加設定元本額	1,127,417,871円
同期中における一部解約元本額	541,554,579円
2022年10月26日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	68,757,473円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	138,890,778円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	107,176,523円
イオン・バランス戦略ファンド	19,719,732円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	2,219,158,551円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	18,182,885円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	58,897,252円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	44,535,817円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	157,606,351円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	88,352,818円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	69,295,437円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	29,683,194円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,399,763円
三井住友D S・国内リートインデックス年金ファンド	126,744,228円



日興FWS・Jリートインデックス	338,624,499円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	24,490,704円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	3,493,800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>	63,085,945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>	12,530,952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>	16,580,068円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%)<適格機関投資家限定>	119,936,929円
合計	3,728,143,699円

## 外国リート・インデックス・マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2022年4月26日現在)	(2022年10月26日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	257,992,966	156,805,469
金銭信託	2,592,223	1,713,995
コール・ローン	130,749,860	46,453,838
投資証券	23,371,768,716	24,218,292,205
派生商品評価勘定	-	51,977
未収入金	1,057,708	-
未収配当金	19,378,538	17,231,878
流動資産合計	23,783,540,011	24,440,549,362
資産合計	23,783,540,011	24,440,549,362
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,182,626	138,893
未払解約金	11,984,072	14,455,487
その他未払費用	220	196
流動負債合計	13,166,918	14,594,576
負債合計	13,166,918	14,594,576
純資産の部		
元本等		
元本	7,379,512,147	8,683,888,798
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	16,390,860,946	15,742,065,988
元本等合計	23,770,373,093	24,425,954,786
純資産合計	23,770,373,093	24,425,954,786
負債純資産合計	23,783,540,011	24,440,549,362

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年4月27日 至 2022年10月26日
----	-------------------------------

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年4月26日現在)	(2022年10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	7,379,512,147口	8,683,888,798口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.2211円 (1万口当たりの純資産額32,211円)	1口当たり純資産額 2.8128円 (1万口当たりの純資産額28,128円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年10月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2022年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	78,000,000	-	77,319,579	680,421
	カナダ・ドル	1,800,000	-	1,782,470	17,530
	オーストラリア・ドル	9,300,000	-	9,098,200	201,800
	香港・ドル	1,500,000	-	1,485,772	14,228
	シンガポール・ドル	3,000,000	-	2,963,276	36,724
	イギリス・ポンド	6,800,000	-	6,650,632	149,368
	ユーロ	4,800,000	-	4,717,445	82,555
	小計	105,200,000	-	104,017,374	1,182,626
合計	105,200,000	-	104,017,374	1,182,626	

(2022年10月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	22,000,000	-	21,886,032	113,968
	オーストラリア・ドル	7,500,000	-	7,475,075	24,925
	小計	29,500,000	-	29,361,107	138,893
	売建				
	アメリカ・ドル	9,700,000	-	9,648,023	51,977
	小計	9,700,000	-	9,648,023	51,977
合計	39,200,000	-	39,009,130	86,916	

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(2022年4月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	4,897,225,610円
同期中における追加設定元本額	3,515,870,384円
同期中における一部解約元本額	1,033,583,847円
2022年4月26日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	14,691,068円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	15,848,872円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	10,883,264円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	6,414,868,609円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	4,238,171円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	50,724,245円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	36,847,018円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	121,474,215円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	63,639,316円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	52,163,859円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	63,412,875円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	551,319円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド	132,295,590円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	65,236,916円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	168,671,758円
三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド	3,412,797円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	37,893,158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>	43,784,034円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%)<適格機関投資家限定>	78,875,063円
合計	7,379,512,147円

(2022年10月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	7,379,512,147円
同期中における追加設定元本額	1,619,772,921円
同期中における一部解約元本額	315,396,270円
2022年10月26日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	13,654,762円

アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	14,980,843円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	10,475,502円
イオン・バランス戦略ファンド	14,692,079円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	7,314,582,442円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	6,254,553円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	58,606,602円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	42,773,776円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	152,883,722円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	85,518,956円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	67,523,217円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	89,727,626円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	845,457円
三井住友D S・外国リートインデックス年金ファンド	221,999,226円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	62,153,797円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	358,554,833円
三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド	24,247,740円
S M A M・世界リート・インデックスファンドV A <適格機関投資家限定>	37,778,851円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	36,663,613円
S M D A M・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%)<適格機関投資家限定>	69,971,201円
合計	8,683,888,798円

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2022年4月26日現在)	(2022年10月26日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	8,823,285	15,885,767
コール・ローン	445,040,057	430,546,803
国債証券	108,663,423,560	102,193,812,270
地方債証券	9,869,641,000	10,002,864,900
特殊債券	9,355,166,234	9,435,537,330
社債券	5,077,580,900	6,805,139,600
未収入金	-	298,072,000
未収利息	244,695,528	229,599,774
前払費用	3,832,499	5,288,579
流動資産合計	133,668,203,063	129,416,747,023
資産合計	133,668,203,063	129,416,747,023
負債の部		
流動負債		
未払金	-	396,190,200
未払解約金	240,908	1,200,000
その他未払費用	1,265	1,751
流動負債合計	242,173	397,391,951
負債合計	242,173	397,391,951

純資産の部		
元本等		
元本	106,516,151,054	105,369,916,564
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	27,151,809,836	23,649,438,508
元本等合計	133,667,960,890	129,019,355,072
純資産合計	133,667,960,890	129,019,355,072
負債純資産合計	133,668,203,063	129,416,747,023

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年4月27日 至 2022年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年4月26日現在)	(2022年10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	106,516,151,054口	105,369,916,564口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2549円 (1万口当たりの純資産額12,549円)	1口当たり純資産額 1.2244円 (1万口当たりの純資産額12,244円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年10月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

(2022年4月26日現在)

## 開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	102,129,036,469円
同期中における追加設定元本額	21,666,315,900円
同期中における一部解約元本額	17,279,201,315円

## 2022年4月26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)	6,923,178,718円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	11,786,209,165円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,712,289,325円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	840,055,482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)	44,220,066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)	776,225,280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)	393,791,215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)	525,712,133円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	140,007,655円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	2,027,250,671円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,067,412,920円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	428,125,024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)	2,013,005,035円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	679,976,897円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	1,079,337,052円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	252,769,138円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	93,799,630円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	160,655,525円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	125,827,246円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	232,432,159円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	73,539,762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>	1,414,908,868円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	12,052,710,188円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	6,250,509,723円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	15,736,258,422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>	2,172,295,327円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,383,496,689円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	8,382,272,785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)	1,157,953,402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>	1,435,609,974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>	682,051,884円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	209,544,800円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	19,574,044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>	5,119,360,113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<適格機関投資家限定>	5,928,068,863円
合計	106,516,151,054円

(2022年10月26日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	106,516,151,054円
同期中における追加設定元本額	13,109,658,760円
同期中における一部解約元本額	14,255,893,250円
2022年10月26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)	7,485,082,044円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	12,265,562,305円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,844,899,682円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	827,290,859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)	41,200,565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)	189,158,599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)	514,940,426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)	880,088,807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)	455,838,317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)	584,189,447円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	142,007,081円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,924,964,674円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,056,053,003円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	422,825,277円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	61,336,747円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,966,393,247円



三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)	673,514,237円
三井住友・資産最適化ファンド(3 バランス型)	996,140,431円
三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)	223,353,155円
三井住友・資産最適化ファンド(5 成長重視型)	35,698,724円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	196,481,829円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	288,093,214円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	521,924,104円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	150,641,017円
三井住友DS・DCターゲットイヤーフンド2060	8,194,509円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,192,118,950円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	11,049,290,545円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	6,030,118,589円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	15,213,325,789円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	306,310,460円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	515,791,535円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	257,148,532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>	123,612,741円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,782,048,124円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,056,956,577円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,200,021,259円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	7,974,023,536円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	961,967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)	1,097,163,390円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	399,654,186円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	493,095,820円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	171,990,647円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	43,587,883円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,305,512,759円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,004,586,088円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	639,993,300円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	210,001,663円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	20,814,251円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	261,739,228円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	4,938,072,007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>	1,212,855,473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>	1,399,189,185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>	1,788,397,969円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	5,925,661,811円
合計	105,369,916,564円

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位:円)

(2022年4月26日現在)

(2022年10月26日現在)

資産の部

流動資産

預金	211,176,152	246,413,459
金銭信託	5,445,859	6,387,638
コール・ローン	274,685,132	173,122,074
国債証券	154,868,895,807	153,597,425,582
派生商品評価勘定	141,836	1,606,746
未収入金	-	633,497,069
未収利息	1,049,674,843	1,136,472,714
前払費用	52,885,106	50,314,935
流動資産合計	156,462,904,735	155,845,240,217
資産合計	156,462,904,735	155,845,240,217
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	633,871
未払解約金	165,954,422	291,793,579
その他未払費用	859	2,490
流動負債合計	165,955,281	292,429,940
負債合計	165,955,281	292,429,940
純資産の部		
元本等		
元本	78,572,267,228	76,282,255,423
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	77,724,682,226	79,270,554,854
元本等合計	156,296,949,454	155,552,810,277
純資産合計	156,296,949,454	155,552,810,277
負債純資産合計	156,462,904,735	155,845,240,217

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2022年4月27日 至 2022年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年4月26日現在)	(2022年10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	78,572,267,228口	76,282,255,423口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.9892円 (1万口当たりの純資産額19,892円)	1口当たり純資産額 2.0392円 (1万口当たりの純資産額20,392円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年10月26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)

(2022年4月26日現在)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	235,598,096	-	235,544,702	53,394
	イギリス・ポンド	32,575,418	-	32,566,006	9,412
	メキシコ・ペソ	30,682,438	-	30,670,282	12,156
	ユーロ	194,426,170	-	194,359,296	66,874
	小計	493,282,122	-	493,140,286	141,836
合計		493,282,122	-	493,140,286	141,836

(2022年10月26日現在)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

区分	種類	契約額等		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	1,074,542	-	1,069,210	5,332
	小計	1,074,542	-	1,069,210	5,332
	売建				
	アメリカ・ドル	373,368,907	-	371,762,161	1,606,746
	カナダ・ドル	18,557,509	-	18,565,030	7,521
	イギリス・ポンド	30,147,758	-	30,381,204	233,446
	ユーロ	218,606,299	-	218,993,871	387,572
	小計	640,680,473	-	639,702,266	978,207
合計		641,755,015	-	640,771,476	972,875

## （注）1．時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## （その他の注記）

（2022年4月26日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	84,390,597,281円
同期中における追加設定元本額	10,759,091,011円
同期中における一部解約元本額	16,577,421,064円
2022年4月26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	24,404,431,209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
S M A M・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	117,929,040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）	28,777,610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)	93,657,355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)	23,180,349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D S・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N I S A・世界分散ファンド	136,355,816円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	301,813,312円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	14,359,695円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	42,018,400円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	30,944,093円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,203,842円
日興F W S・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	226,959,316円
三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド	4,226,574円
S M A M・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	3,835,643,626円
S M A M・バランスファンドV A安定成長型<適格機関投資家限定>	40,032,740円
S M A M・バランスファンドV A 2 5<適格機関投資家専用>	6,760,871,438円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用>	4,399,167,424円
S M A M・バランスファンドV A 5 0<適格機関投資家専用>	10,143,367,252円
S M A M・バランスファンドV L 3 0<適格機関投資家限定>	34,375,893円
S M A M・バランスファンドV L 5 0<適格機関投資家限定>	87,983,369円
S M A M・バランスファンドV A 7 5<適格機関投資家専用>	690,283,030円
S M A M・バランスファンドV L国際分散型<適格機関投資家限定>	117,223,907円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5<適格機関投資家専用>	1,014,133,750円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0<適格機関投資家専用>	1,376,833,275円
S M A M・バランスファンドV A 4 0<適格機関投資家専用>	1,520,894,654円
S M A M・バランスファンドV A 3 5<適格機関投資家専用>	4,660,449,956円
S M A M・バランスV A株4 0 T<適格機関投資家限定>	627,347円
S M A M・外国債券パッシブファンドV A<適格機関投資家限定>	7,806,718,281円
三井住友・外国債券インデックスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	319,831,085円
S M A M・グローバルバランス4 0 V A<適格機関投資家限定>	140,778,313円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A<適格機関投資家専用>	78,444,198円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A<適格機関投資家専用>	33,971,193円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A<適格機関投資家専用>	11,926,289円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 L<適格機関投資家専用>	95,205,741円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L<適格機関投資家専用>	404,375,583円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A 2<適格機関投資家専用>	98,336,933円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A 2<適格機関投資家専用>	39,422,989円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A 2<適格機関投資家専用>	5,252,180円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L 2<適格機関投資家専用>	991,937,006円

S M A M・グローバルバランスファンド(標準型) V A < 適格機関投資家限定 >	577,077,596円
S M A M・グローバルバランスファンド(債券重視型) V A < 適格機関投資家限定 >	847,744,078円
S M A M・世界バランスファンド V A < 適格機関投資家限定 >	754,418,443円
S M A M・世界バランスファンド V A 2 < 適格機関投資家限定 >	341,578,053円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド< 適格機関投資家限定 >	190,502,250円
S M A M・マルチアセットストラテジーファンド2016-04< 適格機関投資家限定 >	124,850,498円
S M A M・マルチアセットストラテジー・オープン< 適格機関投資家限定 >	159,858,275円
S M A M・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	211,033,507円
合 計	78,572,267,228円

(2022年10月26日現在)

## 開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	78,572,267,228円
同期中における追加設定元本額	4,879,711,075円
同期中における一部解約元本額	7,169,722,880円

## 2022年10月26日現在の元本の内訳

三井住友・D C 外国債券インデックスファンド S	25,565,143,508円
三井住友・D C 年金バランス30(債券重点型)	832,576,702円
三井住友・D C 年金バランス50(標準型)	2,154,600,824円
三井住友・D C 年金バランス70(株式重点型)	1,173,333,713円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	150,760,960円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	6,250,590円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	28,036,019円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	94,559,836円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	247,656,129円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	175,366,454円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	282,636,366円
三井住友・D C 年金バランスゼロ(債券型)	23,301,997円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	48,348,165円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	71,389,406円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	49,801,190円
イオン・バランス戦略ファンド	165,904,612円
三井住友D S・D C ターゲットイヤーファンド2050	22,453,694円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	77,033,842円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	57,841,285円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	152,703,744円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	45,415,312円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	22,253,366円
三井住友・D C つみたてN I S A・世界分散ファンド	159,173,419円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	589,693,061円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	32,214,613円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	91,055,288円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	61,209,417円
三井住友D S・D C ターゲットイヤーファンド2060	3,006,179円
日興F W S・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	714,029,001円
三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド	29,509,587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>	3,738,473,746円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	32,123,395円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	5,876,477,744円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	4,006,442,341円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	9,329,262,129円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	30,929,407円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	78,245,722円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	627,968,023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>	111,843,878円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	949,869,564円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,268,921,919円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,340,540,156円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	4,173,251,580円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	604,716円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	7,108,782,341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)	310,310,043円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	122,044,909円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	67,999,510円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	31,256,873円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,592,229円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	79,935,071円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	367,160,341円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	87,815,936円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	37,410,392円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,501,058円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	901,066,219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>	549,761,732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>	752,624,141円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	441,655,483円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	280,587,013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>	101,513,665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>	21,093,706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>	26,980,302円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	284,951,860円
合計	76,282,255,423円

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2022年4月26日現在)	(2022年10月26日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	27,275,290	41,203,054
金銭信託	3,473,575	7,574,516
コール・ローン	175,204,587	205,289,661
国債証券	26,250,030,345	25,724,484,634

派生商品評価勘定	3,271,309	4,086,991
未収入金	2,276,442	994,716
未収利息	134,293,222	161,104,874
前払費用	33,807,273	24,583,672
流動資産合計	26,629,632,043	26,169,322,118
資産合計	26,629,632,043	26,169,322,118
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	707,126,924	758,849,138
未払金	12,354,515	2,082,593
未払解約金	1,000,000	15,400,000
その他未払費用	616	587
流動負債合計	720,482,055	776,332,318
負債合計	720,482,055	776,332,318
純資産の部		
元本等		
元本	18,855,361,405	20,338,145,502
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	7,053,788,583	5,054,844,298
元本等合計	25,909,149,988	25,392,989,800
純資産合計	25,909,149,988	25,392,989,800
負債純資産合計	26,629,632,043	26,169,322,118

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2022年4月27日 至 2022年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>



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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年4月26日現在)	(2022年10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	18,855,361,405口	20,338,145,502口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.3741円 (1万口当たりの純資産額13,741円)	1口当たり純資産額 1.2485円 (1万口当たりの純資産額12,485円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年10月26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)

(2022年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	12,764,125,201	-	13,303,120,810	538,995,609
	カナダ・ドル	537,103,222	-	549,889,380	12,786,158
	オーストラリア・ドル	431,601,589	-	432,161,340	559,751
	シンガポール・ドル	240,762,153	-	248,075,040	7,312,887
	イギリス・ポンド	1,432,825,579	-	1,450,035,200	17,209,621
	イスラエル・シケル	113,572,262	-	115,075,920	1,503,658
	デンマーク・クローネ	109,176,944	-	110,431,800	1,254,856
	ノルウェー・クローネ	69,538,844	-	70,023,500	484,656

	スウェーデン・ク ローナ	75,018,208	-	75,612,500	594,292
	メキシコ・ペソ	196,132,224	-	201,962,754	5,830,530
	オフショア・人民元	392,885,374	-	396,512,754	3,627,380
	ポーランド・ズロチ	119,218,611	-	120,603,550	1,384,939
	ユーロ	9,924,318,899	-	10,036,630,177	112,311,278
	小計	26,406,279,110	-	27,110,134,725	703,855,615
	合 計	26,406,279,110	-	27,110,134,725	703,855,615

(2022年10月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち 1年超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	13,239,693,237	-	13,578,382,356	338,689,119
	カナダ・ドル	523,736,842	-	541,516,297	17,779,455
	オーストラリア・ド ル	386,929,660	-	392,702,752	5,773,092
	シンガポール・ドル	243,694,726	-	252,499,896	8,805,170
	イギリス・ポンド	1,055,824,270	-	1,110,743,136	54,918,866
	イスラエル・シユケ ル	94,605,745	-	98,046,167	3,440,422
	デンマーク・クロー ネ	90,962,721	-	94,255,140	3,292,419
	ノルウェー・クロー ネ	50,205,090	-	53,486,121	3,281,031
	スウェーデン・ク ローナ	64,606,159	-	66,598,610	1,992,451
	メキシコ・ペソ	211,153,662	-	219,349,650	8,195,988
	オフショア・人民元	841,988,710	-	838,512,627	3,476,083
	ポーランド・ズロチ	106,498,863	-	112,820,232	6,321,369
	ユーロ	8,444,369,828	-	8,750,118,676	305,748,848
	小計	25,354,269,513	-	26,109,031,660	754,762,147
合 計	25,354,269,513	-	26,109,031,660	754,762,147	

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しておりま  
す。計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為  
替予約は当該仲値で評価しております。計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下  
の方法によっております。

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

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

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(2022年4月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	13,008,296,854円
同期中における追加設定元本額	12,051,443,547円
同期中における一部解約元本額	6,204,378,996円
2022年4月26日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	3,296,843,012円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,961,569,030円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	794,172,937円
イオン・バランス戦略ファンド	990,054,894円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,966,334,846円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	743,710,240円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	1,325,826,094円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	322,764,675円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	84,406,317円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	47,175,053円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)	426,749,820円
S M A M・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,263,462,001円
S M A M・バランスV A株40T<適格機関投資家限定>	826,366円
S M A M・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	4,377,678,068円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	379,170,766円
S M A M・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	384,686,299円
S M A M・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	489,930,987円
合計	18,855,361,405円

(2022年10月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	18,855,361,405円
同期中における追加設定元本額	4,290,257,210円
同期中における一部解約元本額	2,807,473,113円
2022年10月26日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	3,247,849,622円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	2,004,157,726円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	812,805,747円
イオン・バランス戦略ファンド	861,291,159円

三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	2,576,970,410円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	981,536,309円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	1,815,495,791円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	452,497,885円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	143,163,918円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	61,465,057円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)	455,602,080円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,154,681,049円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	885,316円
SMAM・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	4,384,454,557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>	378,240,653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>	440,626,318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>	566,421,905円
合計	20,338,145,502円

## 米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位:円)

(2022年10月26日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	41,838,690
金銭信託	785,486
コール・ローン	21,288,785
国債証券	2,721,555,125
未収利息	19,748,600
前払費用	6,860,943
流動資産合計	2,812,077,629
資産合計	
2,812,077,629	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	71,148
その他未払費用	98
流動負債合計	71,246
負債合計	
71,246	
純資産の部	
元本等	
元本	3,058,015,296
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	246,008,913
元本等合計	2,812,006,383
純資産合計	
2,812,006,383	
負債純資産合計	
2,812,077,629	

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年4月27日 至 2022年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	3,058,015,296口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 246,008,913円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9196円 (1万口当たりの純資産額9,196円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年10月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>

(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)

(2022年10月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	16,374,710	-	16,303,562	71,148
	小計	16,374,710	-	16,303,562	71,148
合計		16,374,710	-	16,303,562	71,148

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(2022年10月26日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	1,239,791,123円
同期中における追加設定元本額	2,171,538,173円
同期中における一部解約元本額	353,314,000円
2022年10月26日現在の元本の内訳	
日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)	315,944,109円
日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)	1,829,038,648円
三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド	11,956,055円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	176,545,209円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	425,820,622円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	298,710,653円

合 計

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## アセットアロケーション・ファンド（安定型）

2022年11月30日現在

資産総額	8,370,826,205円
負債総額	53,144,834円
純資産総額（ - ）	8,317,681,371円
発行済口数	8,512,967,257口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	0.9771円 （9,771円）

## アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

2022年11月30日現在

資産総額	7,094,917,129円
負債総額	16,268,775円
純資産総額（ - ）	7,078,648,354円
発行済口数	6,689,297,710口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	1.0582円 （10,582円）

## アセットアロケーション・ファンド（成長型）

2022年11月30日現在

資産総額	3,704,461,818円
負債総額	3,627,342円
純資産総額（ - ）	3,700,834,476円
発行済口数	3,357,236,124口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	1.1023円 （11,023円）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

## イ 名義書換

該当事項はありません。

## ロ 受益者名簿

作成しません。



## 八 受益者に対する特典

ありません。

## 二 受益権の譲渡および譲渡制限等

### (イ) 受益権の譲渡

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

### (ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

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

## ホ 受益権の再分割

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

## ヘ 償還金

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

## ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### イ 資本金の額および株式数

	2022年11月30日現在
資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060株

###### ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

##### 八 会社の機構

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

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

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

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

##### 二 投資信託の運用の流れ



##### 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2022年11月30日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	711	9,311,404
単位型株式投資信託	97	457,387
追加型公社債投資信託	1	25,427
単位型公社債投資信託	183	302,632
合計	992	10,096,851

### 3【委託会社等の経理状況】

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

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

なお、当中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）は、改正府令附則第3条第1項ただし書きにより、改正後の中間財務諸表等規則に基づいて作成しております。

2 当社は、第37期（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、第38期中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

#### (1)【貸借対照表】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (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		当事業年度	
	(自	2020年4月1日	(自	2021年4月1日
	至	2021年3月31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 hands 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		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	8,460,037	84,095,946	949,365	949,365	85,045,311
当期変動額					
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。

##### 退職給付見込額の期間帰属方法

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

##### 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

### 4. 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いません。

#### (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

## 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。

## 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 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 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) その他有価証券」には含めておりません。

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

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

（注3）金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（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 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
<b>繰延税金資産</b>		
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
<b>繰延税金負債</b>		
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

#### 営業収益

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

#### 有形固定資産

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

### (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

## 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

## 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 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

#### 営業収益

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

#### 有形固定資産

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

### (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

## 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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



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

## (関連当事者情報)

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (1)兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の子会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	3,728,851	未払 手数料	863,159
親会社の子会社	SMBC日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	5,578,226	未払 手数料	1,070,559

(注) 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	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	4,727,024	未払 手数料	1,098,966
親会社の子会社	SMBC日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	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いません。

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

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

	前事業年度 (自 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

## 中間財務諸表

## (1)中間貸借対照表

(単位：千円)

第38期中間会計期間 (2022年 9月 30日)	
資産の部	
流動資産	
現金及び預金	35,409,452
金銭の信託	9,386,865
顧客分別金信託	300,043
前払費用	601,040
未収委託者報酬	11,798,214
未収運用受託報酬	2,759,722
未収投資助言報酬	386,860
未収収益	40,783
その他	307,594
流動資産合計	60,990,577
固定資産	
有形固定資産	1 2,044,583
無形固定資産	
のれん	3,197,680
顧客関連資産	12,501,978
その他	2,865,181
無形固定資産合計	18,564,839
投資その他の資産	
投資有価証券	11,924,303
関係会社株式	11,850,598
その他	1,571,118
貸倒引当金	20,750
投資その他の資産合計	25,325,270
固定資産合計	45,934,694
資産合計	106,925,272
負債の部	
流動負債	
リース債務	2,564
顧客からの預り金	28,648
その他の預り金	93,717
未払金	5,378,614
未払費用	4,957,793
未払法人税等	910,281
前受収益	32,553
賞与引当金	1,973,312

その他	2	482,541
流動負債合計		13,860,025
固定負債		
リース債務		3,243
繰延税金負債		987,563
退職給付引当金		5,137,995
固定負債合計		6,128,802
負債合計		19,988,828
純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,628,984
その他資本剰余金		73,466,962
資本剰余金合計		82,095,946
利益剰余金		
利益準備金		284,245
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		2,489,135
利益剰余金合計		2,773,380
株主資本合計		86,869,326
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		67,117
評価・換算差額等合計		67,117
純資産合計		86,936,444
負債純資産合計		106,925,272

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		31,446,166
運用受託報酬		4,428,746
投資助言報酬		607,317
その他の営業収益		126,597
営業収益計		36,608,828
営業費用		25,074,910
一般管理費	1	9,497,685
営業利益		2,036,233
営業外収益	2	87,533
営業外費用	3	309,096
経常利益		1,814,670
特別損失	4	6,885
税引前中間純利益		1,807,784
法人税、住民税及び事業税		784,532
法人税等調整額		171,342
法人税等合計		613,189
中間純利益		1,194,594

## (3)中間株主資本等変動計算書

第38期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金			利益剰余金	
		資本準備金	その他資本 剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金 繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	3,834,794
当中間期変動額						
剰余金の配当						2,540,254
中間純利益						1,194,594
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）						
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	1,345,660
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	2,489,135

	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	4,119,040	88,214,986	297,138	297,138	88,512,124
当中間期変動額					
剰余金の配当	2,540,254	2,540,254			2,540,254
中間純利益	1,194,594	1,194,594			1,194,594
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）			230,020	230,020	230,020
当中間期変動額 合計	1,345,660	1,345,660	230,020	230,020	1,575,680
当中間期末残高	2,773,380	86,869,326	67,117	67,117	86,936,444

## 注記事項

## （重要な会計方針）

## 1．資産の評価基準及び評価方法

## (1)有価証券

## 子会社株式

移動平均法による原価法

## その他有価証券

市場価格のない株式等以外

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

## (2)金銭の信託

運用目的の金銭の信託

時価法

## 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	8～50年
器具備品	4～15年

## (2)無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

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

## (3)リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

## 3．引当金の計上基準

## (1)貸倒引当金

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

## (2)賞与引当金

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

## (3)退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

## 4．収益及び費用の計上基準

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

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

## (1)委託者報酬

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

## (2)運用受託報酬

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

## (3)投資助言報酬

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

## （会計方針の変更）

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用しております。これによる当中間財務諸表に与える影響はありません。

## （中間貸借対照表関係）

第38期中間会計期間 (2022年9月30日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	1,632,164千円
2.消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。
3.当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。	当座借越極度額の総額 10,000,000千円 借入実行残高 - 差引額 10,000,000千円
4.当社は、子会社であるSumitomo Mitsui DS Asset Management(USA) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、2023年6月までの賃借料総額40,711千円の支払保証を行っております。	

## (中間損益計算書関係)

第38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
1.一般管理費のうち主要なもののれん償却費	152,270千円
減価償却実施額	
有形固定資産	173,639千円
無形固定資産	1,441,546千円
2.営業外収益のうち主要なもの	
為替差益	7,815千円
受取配当金	1,230千円
投資有価証券償還益	20,660千円
投資有価証券売却益	25,620千円
3.営業外費用のうち主要なもの	
投資有価証券償還損	43,419千円
投資有価証券売却損	152,586千円
金銭の信託運用損	113,089千円
4.特別損失のうち主要なもの	
固定資産除却損	6,885千円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

第38期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

## 1.発行済株式数に関する事項

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

## 2.剰余金の配当に関する事項

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

第38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
1.オペレーティング・リース取引 (借主側)	
未経過リース料(解約不能のもの)	
1年以内	1,161,545千円
1年超	1,742,317千円
合計	2,903,862千円

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の時価等に関する事項

第38期中間会計期間（2022年9月30日）

2022年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のないものは、次表には含まれておりません（（注1）参照）。また、現金及び預金、顧客分別金信託、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収投資助言報酬、顧客からの預り金、未払金は、短期間で決済されるため時価が帳簿価格に近似することから、注記を省略しております。

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 金銭の信託	9,386,865	9,386,865	-
(2) 投資有価証券 その他有価証券	11,884,494	11,884,494	-
資産計	21,271,360	21,271,360	-

（注1）市場価格のない金融商品

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額
その他有価証券 非上場株式	39,809
合計	39,809
子会社株式 非上場株式	11,850,598
合計	11,850,598

これらについては、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号2020年3月31日）第5項に従い、1. 金融商品の時価等に関する事項及び2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中には含めておりません。

## 2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

（単位：千円）

区分	時価			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
(1) 金銭の信託	-	9,386,865	-	9,386,865
(2) 投資有価証券 その他有価証券	-	11,884,494	-	11,884,494
資産計	-	21,271,360	-	21,271,360

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

## (1) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、デリバティブ取引は、取引相手先金融機関より提示された価格によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (2) 投資有価証券 その他有価証券

投資有価証券は、市場での取引頻度が低く、活発な市場における相場価格とは認められないため、公表されている基準価額又は取引金融機関から提示された価格により評価しております。

（有価証券関係）

第38期中間会計期間（2022年9月30日）

## 1. 子会社株式

子会社株式（中間貸借対照表計上額 11,850,598千円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

## 2. その他有価証券

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	4,799,952	4,484,899	315,053
小計	4,799,952	4,484,899	315,053
(2)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	7,084,541	7,290,117	205,575
小計	7,084,541	7,290,117	205,575
合計	11,884,494	11,775,016	109,477

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

(デリバティブ取引関係)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

(収益認識関係)

第38期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

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

(セグメント情報等)

第38期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

1.セグメント情報

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

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

2.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位:千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への営業収益	31,446,166	4,428,746	607,317	126,597	36,608,828

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

3.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(1株当たり情報)



第38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
1株当たり純資産額	2,566円76銭
1株当たり中間純利益	35円26銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。	

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

- イ 定款の変更、その他の重要事項
  - (イ) 定款の変更  
該当ありません。
  - (ロ) その他の重要事項  
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(2022年3月末現在)

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

〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

- ・ 名称 株式会社日本カストディ銀行
- ・ 資本金の額 51,000百万円（2022年3月末現在）
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

□ 販売会社

名称	資本金の額（百万円） 2022年3月末現在	事業の内容
株式会社栃木銀行	27,408	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。
株式会社福岡中央銀行	4,000	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。
a u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S B I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。
楽天証券株式会社	17,495	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。
S M B C日興証券株式会社	10,000	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。
フィデリティ証券株式会社	11,757	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。

2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

□ 販売会社

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

3【資本関係】

（持株比率5%以上を記載しています。）  
該当ありません。

第3【その他】

1 目論見書の表紙から本文の前までおよび裏表紙の記載について

- (1) 「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨を記載することがあります。
- (2) 委託会社の金融商品取引業者登録番号を記載することがあります。
- (3) 委託会社のホームページのアドレスおよび他のインターネットのアドレス（これらのアドレスをコード化した図形等も含む）を記載することがあります。
- (4) 請求目論見書の入手方法および投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨を記載することがあります。

- (5) 目論見書の使用開始日を記載することがあります。
  - (6) 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。
  - (7) 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨を記載することがあります。
  - (8) 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載をすることがあります。
  - (9) 当ファンドのロゴおよび委託会社のロゴを記載することがあります。
  - (10) ファンドの形態および属性、申込みにかかる事項、ユニバーサルデザインフォントマークを記載することがあります。
  - (11) 写真、イラスト、図案およびキャッチコピーを採用することがあります。また、ファンドの管理番号等を記載することがあります。
- 2 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。
  - 3 当ファンドの投資信託約款の全文を請求目論見書に掲載することがあります。
  - 4 目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書(交付目論見書)」または「投資信託説明書(請求目論見書)」と称して使用することがあります。
  - 5 評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。
  - 6 有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドの実質的な投資対象資産に共通性がある場合には、当該複数のファンドを一つの投資信託説明書(交付目論見書)で説明することがあります。また、有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドにかかる投資信託説明書(交付目論見書)および投資信託説明書(請求目論見書)を一体のものとして使用することがあります。

**独立監査人の監査報告書**

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 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2022年7月12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」に掲げられているアセットアロケーション・ファンド（安定型）の2021年4月27日から2022年4月26日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットアロケーション・ファンド（安定型）の2022年4月26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 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2022年7月12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」に掲げられているアセットアロケーション・ファンド（安定成長型）の2021年4月27日から2022年4月26日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）の2022年4月26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 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の監査報告書**

2022年7月12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」に掲げられているアセットアロケーション・ファンド（成長型）の2021年4月27日から2022年4月26日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットアロケーション・ファンド（成長型）の2022年4月26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 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2022年11月18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 佐藤 栄裕

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第38期事業年度の中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2022年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任**

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

**中間財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の中間監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。 2 . X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2023年1月10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
--------------------	-------	-------

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているアセットアロケーション・ファンド（安定型）の2022年4月27日から2022年10月26日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットアロケーション・ファンド（安定型）の2022年10月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年4月27日から2022年10月26日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

**中間財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記の中間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. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2023年1月10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
--------------------	-------	-------

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているアセットアロケーション・ファンド（安定成長型）の2022年4月27日から2022年10月26日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）の2022年10月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年4月27日から2022年10月26日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

**中間財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。



- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記の中間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. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2023年1月10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
--------------------	-------	-------

**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているアセットアロケーション・ファンド（成長型）の2022年4月27日から2022年10月26日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットアロケーション・ファンド（成長型）の2022年10月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年4月27日から2022年10月26日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

**中間財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記の中間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. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。