

【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2月21日提出
【発行者名】	三井住友D Sアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 猿田 隆
【本店の所在の場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【事務連絡者氏名】	土屋 裕子
【電話番号】	03-6205-1649
【届出の対象とした募集(売出)内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド 三井住友D S・日経225インデックス・ファンド 三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド 三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド 三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド 三井住友D S・新興国債インデックス・ファンド 三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド 三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド 三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)
【届出の対象とした募集(売出)内国投資信託受益証券の金額】	三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S・日経225インデックス・ファンド 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S・新興国債インデックス・ファンド 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり) 2兆5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド

三井住友D S・日経2 2 5インデックス・ファンド

三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド

三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド

三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド

三井住友D S・新興国債インデックス・ファンド

三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド

三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド

三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

以下、上記ファンドを総称して、「三井住友D S・ポートフォリオ・シリーズ」または「当ファンド」ということがあり、それぞれを「各ファンド」ということがあります。

また、各ファンドを以下の略称でいうことがあります。

三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド	: T O P I Xインデックス
三井住友D S・日経2 2 5インデックス・ファンド	: 2 2 5インデックス
三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド	: 先進国株インデックス
三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド	: 新興国株インデックス
三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド	: 先進国債インデックス
三井住友D S・新興国債インデックス・ファンド	: 新興国債インデックス
三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド	: Jリートインデックス
三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド	: Gリートインデックス
三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド (為替ヘッジあり)	: ゴールドインデックスヘッジ有

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

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

(3)【発行(売出)価額の総額】

各ファンド2兆5,000億円を上限とします。

(4)【発行(売出)価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、以下の通り掲載されます。

ファンド名	掲載名
TOPIXインデックス	SMDTPイ
225インデックス	SMD225イ
先進国株インデックス	SMD先株イ
新興国株インデックス	SMD興株イ
先進国債インデックス	SMD先債イ
新興国債インデックス	SMD興債イ
Jリートインデックス	SMDJリイ
Gリートインデックス	SMDGリイ
ゴールドインデックスヘッジ有	SMD金イH

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

(5) 【申込手数料】

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2月22日から2023年8月28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。

(1 0) 【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。)

(1 1) 【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、各ファンドにつき、取得申込日が以下のお申込不可日に当たる場合には、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。)。

ファンド名	お申込不可日
先進国株インデックス	・ニューヨークの取引所の休業日 ・ロンドンの取引所の休業日
新興国株インデックス	・ニューヨークの取引所の休業日 ・ロンドンの取引所の休業日 ・香港の取引所の休業日
先進国債インデックス	・ニューヨークの銀行の休業日 ・ロンドンの銀行の休業日
新興国債インデックス	・ニューヨークの取引所の休業日 ・ロンドンの取引所の休業日 ・ニューヨークの銀行の休業日 ・ロンドンの銀行の休業日
Gリートインデックス	・ニューヨークの取引所の休業日 ・オーストラリアの取引所の休業日 ・ニューヨークの銀行の休業日
ゴールドインデックスヘッジ有	・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

「TOPIXインデックス」、「225インデックス」、「Jリートインデックス」は、お申込不可日はありません。

ホ クーリング・オフ制度(金融商品取引法第37条の6)の適用

ありません。

ヘ 振替受益権について

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

(参考：投資信託振替制度)

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

各マザーファンドおよびベンチマークについては後述の「2 投資方針」をご参照ください。

ロ 委託会社は、受託会社と合意の上、各ファンド金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

三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

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	国内	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 (収益の源泉)	株式	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
補足分類	インデックス型	目論見書または信託約款において、各種指数の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド

三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド

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	海外	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 (収益の源泉)	株式	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
補足分類	インデックス型	目論見書または信託約款において、各種指数の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド

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	海外	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 (収益の源泉)	債券	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
補足分類	インデックス型	目論見書または信託約款において、各種指数の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド

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	国内	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 (収益の源泉)	不動産投信	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
補足分類	インデックス型	目論見書または信託約款において、各種指数の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド

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	海外	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 (収益の源泉)	不動産投信	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
補足分類	インデックス型	目論見書または信託約款において、各種指数の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

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)	その他資産(商品)	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券および不動産投信以外の資産(商品)を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
補足分類	インデックス型	目論見書または信託約款において、各種指数の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

(ロ) 当ファンドが該当する属性区分

三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

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(株式一般))	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式であり、ファンドの収益は株式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「株式」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	日本	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の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいいます。
対象インデックス	TOPIX	目論見書または信託約款において、TOPIX(東証株価指数)の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

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(株式一般))	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式であり、ファンドの収益は株式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「株式」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	日本	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の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいいます。

対象インデックス	日経225	目論見書または信託約款において、日経平均（日経225）の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。
----------	-------	--

三井住友D S ・先進国株式インデックス・ファンド

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（株式一般））	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であり、ファンドの収益は株式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「株式」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（日本を除く）	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除く世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	その他の指数（MSCIコクサイインデックス（配当込み、円ベース））	目論見書または信託約款において、MSCIコクサイインデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

三井住友D S ・新興国株式インデックス・ファンド

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、株価指数先物取引）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および株価指数先物取引であり、ファンドの収益は株式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「株式」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	エマージング	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エマージング地域（新興成長国（地域））の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

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

三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

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(債券一般))	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債券であり、ファンドの収益は債券市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産(収益の源泉)は「債券」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(日本を除く)	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除く世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	その他の指数(FITSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース))	目論見書または信託約款において、FITSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド

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(債券一般))	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債券であり、ファンドの収益は債券市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産(収益の源泉)は「債券」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	エマージング	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エマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	その他の指数(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))	目論見書または信託約款において、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)の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド

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(不動産投信))	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不動産投信であり、ファンドの収益は不動産投信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「不動産投信」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	日本	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の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいいます。

対象インデックス	その他の指数（東証REIT指数（配当込み））	目論見書または信託約款において、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。
----------	------------------------	---

三井住友D S ・先進国リートインデックス・ファンド

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（不動産投信））	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不動産投信であり、ファンドの収益は不動産投信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「不動産投信」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（日本を除く）	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除く世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	その他の指数（S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース））	目論見書または信託約款において、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

三井住友D S ・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）

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（商品））	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金地金価格との連動を目指す上場投資信託証券であり、ファンドの収益は金市場（商品市場）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「商品」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル（日本を含む）	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジあり(フルヘッジ)	目論見書または信託約款において、対円での為替のフルヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。
対象インデックス	その他の指数(LBMA金価格(円ヘッジ換算ベース))	目論見書または信託約款において、LBMA金価格(円ヘッジ換算ベース)の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

商品分類表

三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド

三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
---------	--------	-------------------	------

単位型 追加型	国内	株式 債券	インデックス型
	海外	不動産投信	特殊型
	内外	その他資産 () 資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

三井住友D S ・国内リートインデックス・ファンド

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

三井住友D S ・先進国リートインデックス・ファンド

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

三井住友D S ・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類

単位型	国内	株式	インデックス型
		債券	
	海外	不動産投信	
追加型		その他資産 (商品)	特殊型
	内外	資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル	ファミリーファンド	日経225
	年2回	日本		
	年4回	北米		
	年6回(隔月)	欧州		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年12回(毎月)	アジア	ファンド・オブ・ファンズ	TOPIX
	日々	オセアニア		
	その他 ()	中南米		
		アフリカ		
不動産投信		中近東(中東)		その他 ()
その他資産 (投資信託証券 (株式 一般))		エマージング		
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル	ファミリーファンド	日経225
	年2回	日本		
	年4回	北米		
	年6回(隔月)	欧州		

公債	年12回(毎月)	アジア	ファンド・オブ・ファンズ	TOPIX
社債	日々	オセアニア		
その他債券	その他	中南米		
クレジット属性 ()	()	アフリカ		
不動産投信		中近東(中東)		
その他資産 (投資信託証券 (株式 一般))		エマージング		
資産複合 ()				その他 ()
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。

三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式	年1回	グローバル (日本を除く)			
一般					
大型株	年2回	日本			日経225
中小型株	年4回	北米			
債券			ファミリーファンド	あり	
一般	年6回(隔月)	欧州			
公債					
社債	年12回(毎月)	アジア			
その他債券					
クレジット属性 ()	日々	オセアニア			TOPIX
不動産投信	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
		アフリカ			
その他資産 (投資信託証券 (株式 一般))		中近東(中東)			その他 (MSCIコクサイイン デックス(配当込 み、円ベース))
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。

三井住友D S ・新興国株式インデックス・ファンド

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル			
	年2回	日本			日経225
	年4回	北米			
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回(隔月)	欧州	ファミリーファンド	あり	
	年12回(毎月)	アジア			
	日々	オセアニア			TOPIX
	その他	中南米			
不動産投信 ()	()	アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株式、株 価指数先物取引)資産配 分変更型))					
		中近東(中東)			その他 (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))
資産複合 () 資産配分固 定型 資産配分変 更型		エマージング			

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

三井住友D S ・先進国債インデックス・ファンド

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を除く)			
	年2回	日本			日経225
	年4回	北米			
債券 一般 公債	年6回(隔月)	欧州	ファミリーファンド	あり	

社債 その他債券 クレジット属 性 ()	年12回(毎月)	アジア			
	日々	オセアニア			TOPIX
	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	
不動産投信		アフリカ			
その他資産 (投資信託証券 (債券 一般))					その他 (FTSE世界国債イ ンデックス(除く日 本、円ベース))
資産複合 ()		中近東(中東)			
資産配分固 定型 資産配分変 更型		エマージング			

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド

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

資産複合 () 資産配分固 定型 資産配分変 更型		エマージング			
---	--	--------	--	--	--

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

三井住友D S ・国内リートインデックス・ファンド

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式	年1回	グローバル		
一般 大型株 中小型株	年2回	日本		日経225
債券	年4回	北米	ファミリーファンド	
一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回(隔月)	欧州		
	年12回(毎月)	アジア		
	日々	オセアニア		TOPIX
不動産投信	その他 ()	中南米 アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	
その他資産 (投資信託証券 (不動産投信))		中近東(中東)		その他 (東証REIT指数(配当込 み))
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング		

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

三井住友D S ・先進国リートインデックス・ファンド

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式	年1回	グローバル (日本を除く)			
一般 大型株 中小型株	年2回	日本			日経225
債券	年4回	北米	ファミリーファンド	あり	
一般 公債 社債	年6回(隔月)	欧州			
	年12回(毎月)	アジア			

その他債券 クレジット属 性 ()	日々	オセアニア			TOPIX
不動産投信 ()	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券 (不動産投信))		アフリカ			その他 (S&P先進国REI T指数(除く日本、 配当込み、円換算 ベース))
資産複合 ()		中近東(中東)			
資産配分固 定型 資産配分変 更型		エマージング			

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式	年1回	グローバル (日本を含む)			
一般 大型株 中小型株	年2回	日本			日経225
	年4回	北米			
債券			ファミリーファンド	あり (フルヘッジ)	
一般 公債	年6回(隔月)	欧州			
社債	年12回(毎月)	アジア			
その他債券 クレジット属 性 ()	日々	オセアニア			TOPIX
不動産投信 ()	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券 (商品))		アフリカ			
		中近東(中東)			その他 (LBMA金価格 (円ヘッジ換算ベ ース))

資産複合 () 資産配分固 定型 資産配分変 更型		エマージング			
---	--	--------	--	--	--

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

2021年8月23日 信託契約締結、設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(イ) 委託会社 「三井住友D Sアセットマネジメント株式会社」

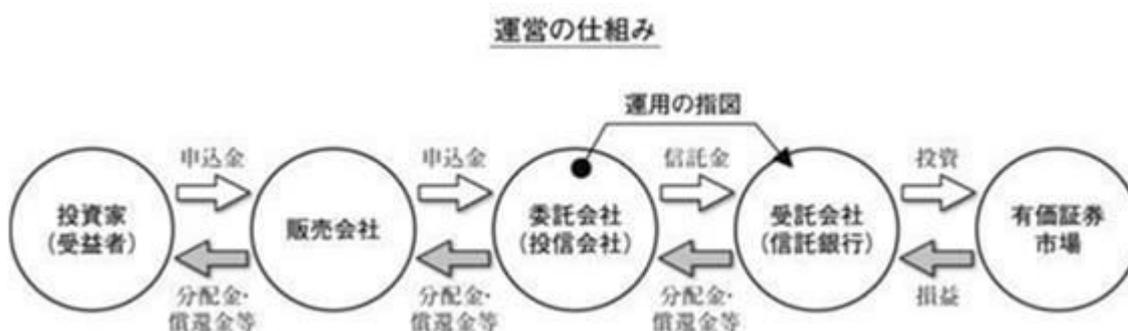
証券投資信託契約に基づき、信託財産の運用指図、投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の作成等を行います。

(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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

(ハ) 販売会社

委託会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問いません。）に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付け、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。



ロ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

20億円（2022年12月30日現在）

(ロ) 会社の沿革

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

(八) 大株主の状況

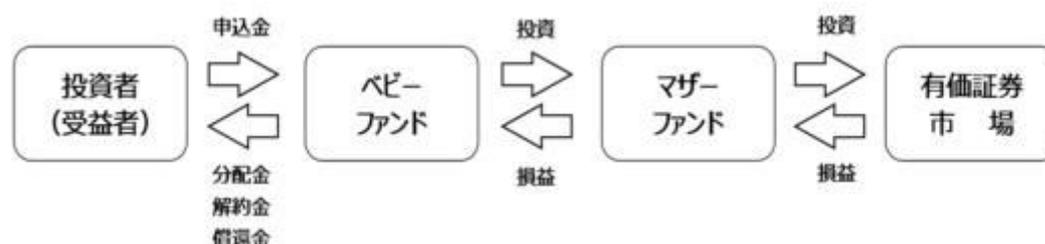
(2022年12月30日現在)

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

八 ファンドの運用形態

各ファンド（三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）を除く）
（ファミリーファンド方式による運用）

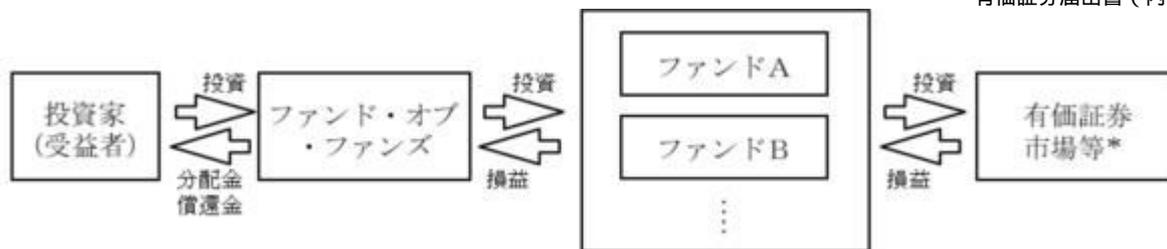
「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、受益者の資金をまとめて「ベビーファンド」とし、「ベビーファンド」の資金の全部または一部を「マザーファンド」に投資することにより、実質的な運用は「マザーファンド」において行う仕組みです。



三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）

（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。



*当ファンドにおいては金現物を含みます。

なお、当ファンドは、「ファミリーファンド方式」を採用しており、実際の他のファンドへの投資は、マザーファンドを通じて行います。

2【投資方針】

(1)【投資方針】

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド

- (イ) 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)への投資を通じて、主としてT O P I X(東証株価指数)に採用されている銘柄の株式に投資することにより、T O P I X(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 株式以外の資産(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。)への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- (ハ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ニ) 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)の組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ホ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

三井住友D S・日経225インデックス・ファンド

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

三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド

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

三井住友D S ・新興国株式インデックス・ファンド

- (イ) エマージング株式インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、主として新興国の株式（預託証書（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することにより、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、運用にあたっては、ファンドの資産規模、市況動向に応じて株式、株価指数先物取引、上場投資信託証券、短期公社債等および為替取引を組み合わせ運用を行います。
- (ロ) エマージング株式インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (ニ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

三井住友D S ・先進国債インデックス・ファンド

- (イ) 外国債券パッシブ・マザーファンドへの投資を通じて、主として外国の国債に投資することにより、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 外国債券パッシブ・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (ニ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

三井住友D S ・新興国債インデックス・ファンド

- (イ) 米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、主として米ドル建ての新興国の公社債に投資することにより、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て運用を行います。ただし、運用の効率性を勘案し、流動性の高い国、銘柄を中心に投資します。
- (ロ) 米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (ニ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

三井住友D S ・国内リートインデックス・ファンド

- (イ) Jリート・インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、実質的に以下の運用を行います。
- ・主として日本の取引所に上場（上場予定を含みます。）している不動産投資信託（REIT）に投資することにより、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
 - ・不動産投資信託（REIT）への投資にあたっては、東証REIT指数採用銘柄（採用予定を含みます。）に投資を行うものとします。
 - ・ベンチマークとの連動を維持するため、不動産投信指数先物取引等を活用する場合があります。このため、不動産投資信託（REIT）の実質組入時価総額と不動産投信指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が純資産総額を超えることがあります。
- (ロ) Jリート・インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

三井住友D S ・先進国リートインデックス・ファンド

- (イ) 外国リート・インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、実質的に以下の運用を行います。
- ・日本を除く世界各国の不動産投資信託（REIT）等に投資することにより、S & P先進

国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

・不動産投資信託(REIT)等への投資にあたっては、S&P先進国REIT指数(除く日本)採用銘柄(採用予定を含みます。)に投資を行うものとします。

(ロ)外国リート・インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。

(ハ)実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

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

三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

(イ)ゴールド・インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、主として、金地金価格との連動を目指す投資信託証券に投資し、実質組入外貨建資産について原則として対円での為替ヘッジを行うことにより、ロンドン貴金属市場協会(LBMA)金価格(円ヘッジ換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

(ロ)ゴールド・インデックス・マザーファンドが主要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、商品性及び運用上の効率性を損なわない範囲で、委託会社の判断により見直しを行うことがあります。

(ハ)ゴールド・インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。

(ニ)実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを活用し、為替変動リスクの低減を図ります。

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

ファンドの特色

1

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

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

2

各ファンドは、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。

ファンド名	ベンチマーク
TOPIXインデックス	TOPIX(東証株価指数、配当込み)
225インデックス	日経平均株価(日経225)
先進国株インデックス	MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)
新興国株インデックス	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
先進国債インデックス	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
新興国債インデックス	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)
Jリートインデックス	東証REIT指数(配当込み)
Gリートインデックス	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)
ゴールドインデックス ヘッジ有	LBMA金価格(円ヘッジ換算ベース)

3

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

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

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

ファンドのしくみ

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

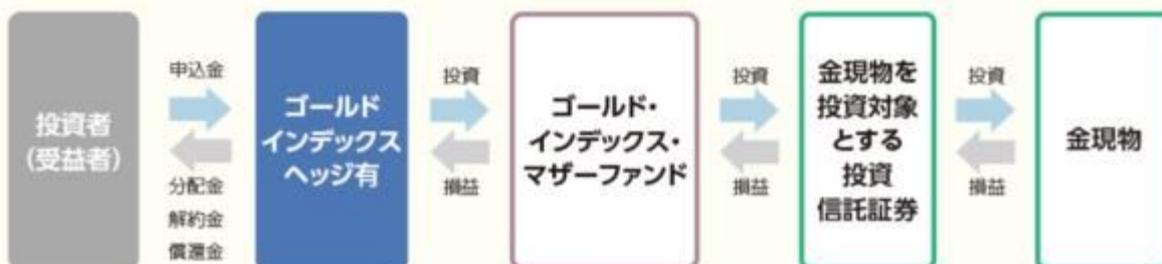
▶各ファンド(ゴールドインデックスヘッジ有を除く)



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

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

▶ゴールドインデックスヘッジ有



各ファンドの運用の基本方針等

▶ 国内株式

TOPIXインデックス

ベンチマーク TOPIX(東証株価指数、配当込み)

運用の基本方針 ● マザーファンドへの投資を通じて、主としてTOPIX(東証株価指数)に採用されている銘柄の株式に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
※株価指数先物取引等を利用することがあります。

225インデックス

ベンチマーク 日経平均株価(日経225)

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

▶ 先進国株式

先進国株インデックス

ベンチマーク MSCIロクサイインデックス(配当込み、円ベース)

運用の基本方針 ● マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を除く世界各国・地域の株式等に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
※株価指数先物取引等を利用することがあります。
● 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
※基準価額は為替変動の影響を受けます。

▶ 新興国株式

新興国株インデックス

ベンチマーク 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)

運用の基本方針 ● マザーファンドへの投資を通じて、主として新興国の株式*、新興国の株式指数を対象とした先物取引および新興国の株式等を対象とする上場投資信託証券(ETF)に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
*預託証券(DR)、株式の値動きに連動する有価証券を含みます。
※ファンドの資産規模、市況動向に応じて株式、株価指数先物取引、上場投資信託証券(ETF)、短期公社債等および為替取引を組み合わせて運用を行います。
● 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
※基準価額は為替変動の影響を受けます。



預託証券(DR)とは

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

▶ 先進国債券

先進国債インデックス

ベンチマーク FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、主として外国の国債に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
- 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
※基準価額は為替変動の影響を受けます。

▶ 新興国債券

新興国債インデックス

ベンチマーク 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)

運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、主として米ドル建ての新興国の公社債に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
※運用の効率性を勘案し、流動性の高い国、銘柄を中心に投資します。
- 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
※基準価額は為替変動の影響を受けます。

▶ 国内リート

Jリートインデックス

ベンチマーク 東証REIT指数(配当込み)

運用の基本方針

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

▶ 外国リート

Gリートインデックス

ベンチマーク S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)

運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を除く世界各国・地域の取引所に上場している不動産投資信託(リート)に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
- 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
※基準価額は為替変動の影響を受けます。

▶ 金

ゴールドインデックスヘッジ有

ベンチマーク	LBMA金価格(円ヘッジ換算ベース)
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ● マザーファンドへの投資を通じて、金地金価格との連動を目指す投資信託証券*に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 <ul style="list-style-type: none"> *マザーファンドが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、商品性および運用上の効率性を損なわない範囲で、委託会社の判断により見直しを行うことがあります。 ※実質的な投資対象とする投資信託証券は、以下の通りです。 <ul style="list-style-type: none"> [iShares Gold Trust] [SPDR Gold MiniShares Trust] ● 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。 <ul style="list-style-type: none"> ※完全に為替変動リスクを回避することはできません。

■ゴールド・インデックス・マザーファンドが投資対象とする投資信託証券の概要

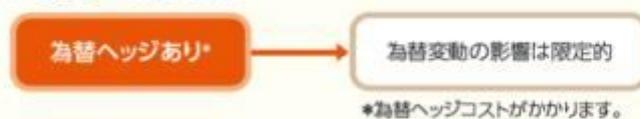
ファンド名	iShares Gold Trust (iシェアーズ ゴールド・トラスト)	SPDR Gold MiniShares Trust (SPDR® ゴールド・ミニシェアーズ・トラスト)
形態	米国籍上場投資信託(米ドル建て)	米国籍上場投資信託(米ドル建て)
管理会社	iShares デラウェア・トラスト・スポンサー・ エルエルシー	WGC USAアセット・マネジメント・カンパニー・ エルエルシー
運用の基本方針	金地金価格の変動に概ね連動することを目標とします。	金地金の価格のパフォーマンスを反映させることを目標とします。
ベンチマーク	LBMA金価格	LBMA金価格
管理費用*1	年0.25%	年0.10%
購入の可否*2	日本において一般投資者の購入が可能です。	日本において一般投資者の購入が可能です。

※1 管理費用とは各上場投資信託(以下「ETF」といいます。)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の直近の目論見書等で開示されているものです。

※2 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。

為替の影響について

▶ 為替ヘッジあり



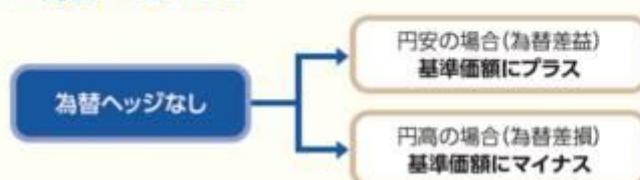
■外貨建資産に対し、対円での為替ヘッジを行う場合、基準価額への為替変動の影響は小さくなると考えられます。ただし、完全に為替変動リスクを回避することはできません。



為替ヘッジ

為替取引等を利用し、為替変動リスクを低減することです。

▶ 為替ヘッジなし



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

各ファンドの運用プロセス



*ユニバースの決定を行わないファンドもあります。

[ポートフォリオの構築手法]

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



最適化法とは

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

層化抽出法とは

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

完全法とは

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

※上記の運用プロセスは今後変更される場合があります。

※ゴールドインデックスヘッジ有については、金現物に投資する投資信託証券への投資により、インデックスの動きへの連動を目指した運用を行います。

追加的記載事項

●各ファンドがベンチマークとする指数の著作権等について

<TOPIXインデックス、Jリートインデックス>

- TOPIX、東証REIT指数の指数値およびTOPIX、東証REIT指数にかかる標章または商標は、株式会社J P X 総研または株式会社J P X 総研の関連会社（以下「J P X」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIX、東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIX、東証REIT指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJ P X が有します。
- J P X は、TOPIX、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIX、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIX、東証REIT指数にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
- J P X は、TOPIX、東証REIT指数の指数値およびTOPIX、東証REIT指数にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日のTOPIX、東証REIT指数の指数値について、何ら保証、言及をすることはありません。
- J P X は、TOPIX、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、J P X は、TOPIX、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- 当ファンドは、J P X により提供、保証または販売されるものではありません。
- J P X は、当ファンドの購入者または公衆に対し、当ファンドの説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。
- J P X は、委託会社または当ファンドの購入者のニーズを、TOPIX、東証REIT指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。
- 以上の項目に限らず、J P X は当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

<225インデックス>

- 日経平均株価は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、日経平均株価自体および日経平均株価を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。
- 日経および日経平均株価を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て株式会社日本経済新聞社に帰属しています。
- 当ファンドは、委託会社の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用および当ファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。
- 株式会社日本経済新聞社は、日経平均株価を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延または中断に関して、責任を負いません。
- 株式会社日本経済新聞社は、日経平均株価の構成銘柄、計算方法、日経平均株価の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

<先進国株インデックス、新興国株インデックス>

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

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

MSCI INDEXは、MSCIの専有財産です。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

<先進国債インデックス>

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)とは、FTSE Fixed Income LLCが算出し公表している指数(FTSE世界国債インデックス)をもとに、委託会社が計算したものです。FTSE世界国債インデックスに関する知的所有権その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
また、同社は当ファンドの運用に関して責任を負うものではありません。

<新興国債インデックス>

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)とは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数(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)をもとに、委託会社が計算したものです。同指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属しております。

JPモルガン指数(以下「指数」といいます。)について提供された情報は、指数のレベルも含め、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買の申込み若しくは勧誘、何らかの取引の公式なコンファメーション、又は指数に関連する何らかの商品の価値算定若しくは値段を構成するものではありません。また、ここに記載されるいかなる情報も、一定の投資戦略の採用を推奨するものとも、法務、税務又は会計上の助言としても理解されてはなりません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は、一般に信頼できるとされているものですが、ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー(以下「JPMorgan」といいます。))は、その完全性又は正確性を保証するものではありません。ここに含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは不確定の将来の収益を示すものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPMorgan、JPMorganの関係会社又はその従業員がロング若しくはショートのポジションを持ち、売買等を行い、又はマーケットメイクをすることがあり、また、そのような発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、又は貸主になる場合もあります。

米国のJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシー(以下「JPMS」といいます。))は、いかなる指数に関連する証券、金融商品又は取引(以下「プロダクト」といいます。))についての援助、保証又は販売促進も行いません。証券若しくは金融商品全般若しくは特定のプロダクトへの投資の妥当性について、又は金融市場における投資機会を指数に連動させることとするものの妥当性について、JPMSは明示又は黙示を問わず、一切の表明又は保証を行いません。JPMSはプロダクトの管理、マーケティング又はトレーディングに関する義務又は責任を負いません。指数は一般に信用できるとされている要素に依拠していますが、JPMSは、その完全性、正確性又は指数に付随して提供されるその他の情報について保証するものではありません。

指数はJPMSのみが保有する財産であり、その財産権は全てJPMSに帰属します。

JPMSはNASD、NYSE、SIPCの会員です。JPMorganはJP Morgan Chase Bank, NA、JPMS、J.P. Morgan Securities Ltd. (FSAの登録を受けたLSEの会員)又はその投資銀行関連会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

当情報の著作権はジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニーに帰属します。

上記和文は下記URLに記載される英文の参考訳であり、英文と上記和文の記載に齟齬がある場合、英文が優先されます。
<https://www.jpmorgan.com/disclosures/gjrg>

<Gリートインデックス>

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

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

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

<ゴールドインデックスヘッジ有>

LBMA金価格(円ヘッジ換算ベース)とは、ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド(ICE Benchmark Administration Limited)が算出し公表している指数(LBMA金価格)をもとに、委託会社が計算したものです。ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッドは、LBMA金価格及びLBMA金価格が示す、あらゆる特定の日、特定の時点における数値により生じた結果について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッドは、当ファンドに関する商品性や特定目的への適合性について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。

(2) 【投資対象】**イ 投資対象とする資産の種類**

- 三井住友D S・TOPIXインデックス・ファンド
- 三井住友D S・日経225インデックス・ファンド
- 三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド
- 三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド

三井住友D S ・先進国債インデックス・ファンド
 三井住友D S ・新興国債インデックス・ファンド
 三井住友D S ・国内リートインデックス・ファンド
 三井住友D S ・先進国リートインデックス・ファンド

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

- 1．有価証券
- 2．デリバティブ取引にかかる権利
- 3．約束手形（金融商品取引法第2条第1項第15号に掲げるものを除きます。）
- 4．金銭債権

(ロ) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

- 1．為替手形

三井住友D S ・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）

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（金融商品取引法第2条第1項第15号に掲げるものを除きます。）
- 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

三井住友D S ・T O P I Xインデックス・ファンド
 三井住友D S ・日経225インデックス・ファンド
 三井住友D S ・先進国株式インデックス・ファンド
 三井住友D S ・新興国株式インデックス・ファンド
 三井住友D S ・先進国債インデックス・ファンド
 三井住友D S ・新興国債インデックス・ファンド

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

- 1．株券または新株引受権証書
- 2．国債証券
- 3．地方債証券
- 4．特別の法律により法人の発行する債券
- 5．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6．資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- 8．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 9．資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- 10．資産の流動化に関する法律に規定する特定目的信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第13号で定めるものをいいます。）
- 11．コマーシャル・ペーパー
- 12．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）お

よび新株予約権証券

13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
 14. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 15. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。次号において同じ。）で次号に定めるもの以外のもの
 16. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下本号において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 17. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
 19. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 21. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
 22. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの
 23. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
- なお、第1号の証券または証書、ならびに第13号、第19号および第21号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第16号の証券ならびに第13号、第19号および第21号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものならびに第19号および第21号の証券または証書のうち第16号の証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第14号および第15号の証券ならびに第19号および第21号の証券または証書のうち第14号および第15号の証券の性質を有するものを以下「投資信託証券」といいます。

三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド

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

1. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）
2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
3. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券または証書の性質を有するもの
4. 投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
5. 投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

なお、第1号の証券にかかる運用の指図は買い現先取引（売戻条件付の買入れ）および債券貸借取引（現金担保付債券借入れ）に限り行うことができます。また、第4号の証券および第5号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド

三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）

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

1. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）

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

なお、第1号の証券にかかる運用の指図は買い現先取引（売戻条件付の買入れ）および債券貸借取引（現金担保付債券借入れ）に限り行うことができます。また、第4号の証券および第5号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

八 投資対象とする金融商品

- 三井住友D S・TOPIXインデックス・ファンド
- 三井住友D S・日経225インデックス・ファンド
- 三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド
- 三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド
- 三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド
- 三井住友D S・新興国債インデックス・ファンド

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

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

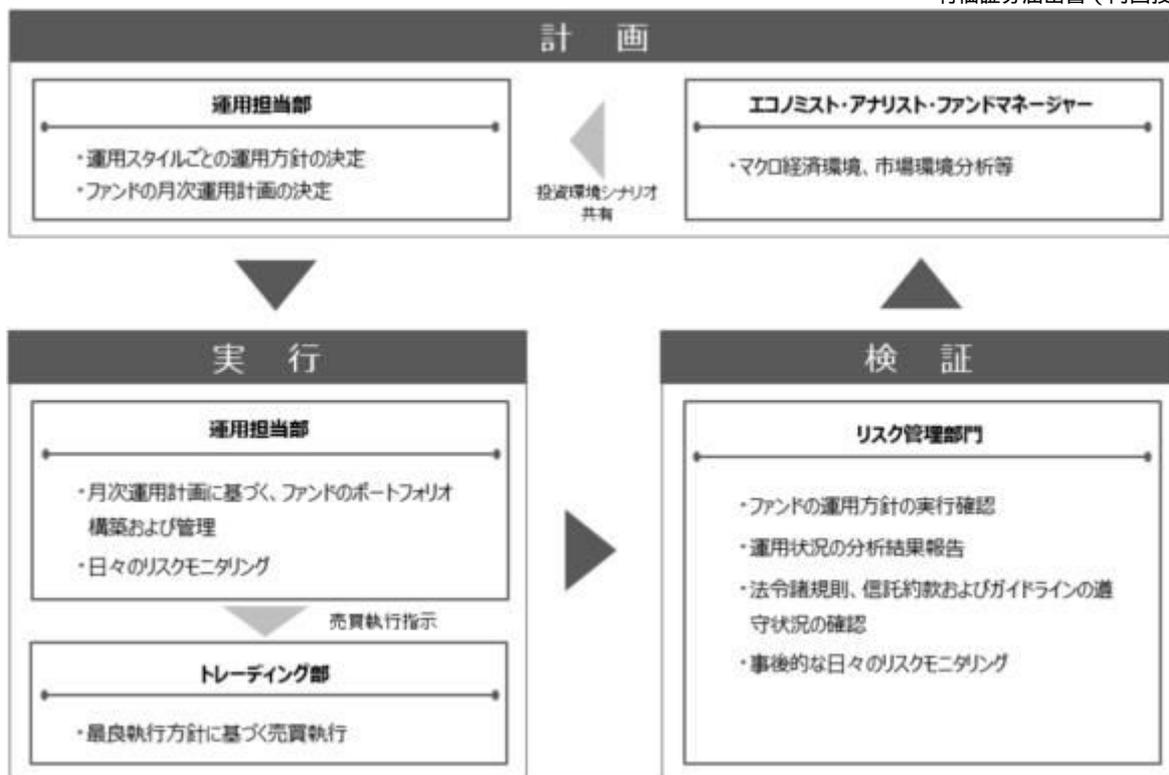
- 三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド
- 三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド
- 三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）

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

（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。

- 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11月30日。休業日の場合は翌営業日となります。）決算を行い、原則として以下の方針に基づき分配金額を決定します。

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

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

（５）【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

- イ 株式への実質投資割合には、制限を設けません。

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

率を合計したものをいいます(以下同じ。)。

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

三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

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

三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド

三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド

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

三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

- イ 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 国債を除く同一発行体の発行する債券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ハ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- ニ 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ホ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド

- イ 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- ハ 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割

合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド

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

三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド

- イ 投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。
- ロ 株式への投資は行いません。
- ハ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- ニ 投資信託証券とコマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限りします。
- ホ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

- イ 投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。
- ロ 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します。
- ハ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- ニ 同一銘柄の投資信託証券への投資割合には、原則として制限を設けません。ただし、当該投資信託証券が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リス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割合は、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。

ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

三井住友D S・TOPIXインデックス・ファンド

三井住友D S・日経225インデックス・ファンド

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

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

八 信用取引の指図

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

二 先物取引等の指図

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

ホ スワップ取引の指図

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

- (ホ) スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ヘ) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

ヘ 金利先渡取引の指図

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

ト 有価証券の貸付けの指図

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

チ 有価証券の空売りの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡または買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (ロ) 上記(イ)の売付けの指図は、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

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

リ 有価証券の借入れの指図

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

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

(ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。

(ニ) 上記(イ)の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

ヌ 資金の借入れ

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

(ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内

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

(ニ) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド

三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド

三井住友D S・新興国債インデックス・ファンド

イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

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

ロ 投資する株式等の範囲

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

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

ハ 信用取引の指図

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

- (ロ) 上記(イ)の信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けにかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 上記(ロ)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けにかかる建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (二) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

ニ 先物取引等の指図

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

ホ スワップ取引の指図

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

ヘ 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を

行うことの指図をすることができます。

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

ト 有価証券の貸付けの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次

の各号の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。

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

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

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

チ 有価証券の空売りの指図

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

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

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

リ 有価証券の借入れの指図

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

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

(ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。

(ニ) 上記(イ)の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

ヌ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ル 外国為替予約取引の指図

(イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

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

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

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

ヲ 資金の借入れ

(イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みま

す。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。
 1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
 2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
 3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内
- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (ニ) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

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

ロ 投資する株式等の範囲

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

ハ 同一発行体の発行する公社債への投資制限

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する同一の発行体にかかる公社債(日本および外国の国債証券を除きます。以下同じ。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該同一発行体にかかる公社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- (ロ) 上記(イ)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

ニ 信用取引の指図

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

ホ 先物取引等の指図

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

ヘ スワップ取引の指図

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

ト 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先

渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

- (二) 上記(八)においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ホ) 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ヘ) 委託会社は、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- (ト) 「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- (チ) 「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間にかかる為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下同じ。)を取り決め、その取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- (リ) 「直物為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金の授受を約する取引、その他これに類似する取引をいいます。

チ 有価証券の貸付けの指図

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

リ 有価証券の空売りの指図

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

ヌ 有価証券の借入れの指図

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

ル 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ロ 外国為替予約取引の指図

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

ワ 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します。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額としします。
 1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
 2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内

3．借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内

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

三井住友D S ・国内リートインデックス・ファンド

イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

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

ロ 公社債の借入れの指図

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

ハ 先物取引等の指図

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

二 資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。
 - 1．一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
 - 2．一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
 - 3．借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内
- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (ニ) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

三井住友D S ・先進国リートインデックス・ファンド

イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

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

ロ 公社債の借入れの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提

供の指図をするものとします。

- (ロ) 上記(イ)の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- (ニ) 上記(イ)の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

八 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

二 外国為替予約取引の指図

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

ホ 先物取引等の指図

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

ヘ 資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。
 1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
 2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
 3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内
- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (ニ) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

イ 公社債の借入れの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認められたときは、担保の提供の指図をするものとします。
- (ロ) 上記(イ)の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

(二) 上記(イ)の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

□ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

八 外国為替予約取引の指図

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

二 資金の借入れ

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

(ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内

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

(二) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

法令に基づく投資制限

イ 同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。）が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。

ロ デリバティブ取引にかかる投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）

委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。）を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。

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

委託会社は、運用財産に関し、信用リスク（保有する有価証券その他の資産について取引の相手方の債務不履行その他の理由により発生し得る危険をいいます。）を適正に管理する方法として

あらかじめ委託会社が定めた合理的な方法に反することとなる取引を行うことを受託会社に指図しないものとします。

(参考情報：マザーファンドの投資方針等)

(国内株式インデックス・マザーファンド(B号))

(1) 投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

(イ) 主としてTOPIX(東証株価指数)に採用されている銘柄の株式に投資を行い、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

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

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

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

1. 株券または新株引受権証書

2. 国債証券

3. 特別の法律により法人の発行する債券

4. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

7. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

ハ 投資対象とする金融商品

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

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 外貨建資産への投資は行いません。

(ロ) 株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

る目的以外には利用しません。

(225マザーファンド)

(1)投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

(ロ)株式の組入比率は高位を保ちます。

(ハ)運用の効率化を図るため、日経平均先物取引を利用することもあります。

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

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

(2)投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

1.株券または新株引受権証書

2.コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

3.外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、前号の証券の性質有するもの

4.指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

5.抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

6.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

なお、第1号の証券または証書を以下「株式」といいます。

ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2)投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載した三井住友DS・225インデックス・ファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

(3)投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ)株式への投資割合には制限を設けません。

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

(外国株式インデックス・マザーファンド)

(1)投資方針等

イ 基本方針

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

□ 投資態度

- (イ) 主として世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを行わないものとします。
- (ハ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

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

ハ 投資対象とする金融商品

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

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- (イ) 株式への投資割合には制限を設けません。
- (ロ) 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

- (八) 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。
- (二) デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- (ホ) 外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

(エマージング株式インデックス・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

M S C Iエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

- (イ) 主として新興国の株式(預託証券(D R)、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、M S C Iエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 運用にあたっては、ファンドの資産規模、市況動向に応じて株式、株価指数先物取引、上場投資信託証券、短期公社債等および為替取引を組み合わせ運用を行います。
- (ハ) 外貨建資産について円に対する為替ヘッジは原則として行いません。
- (ニ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
6. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))お

よび新株予約権証券

12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
21. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

八 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針（2）投資対象 八 投資対象とする金融商品」において記載した三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

(外国債券パッシブ・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

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

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

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

21. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

八 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 八 投資対象とする金融商品」において記載した三井住友DS・先選国債インデックス・ファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

(米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

JPMorgan・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て運用を行います。

ロ 投資態度

- (イ) 主として米ドル建ての新興国の公社債に投資することにより、JPMorgan・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て運用を行います。ただし、運用の効率性を勘案し、流動性の高い国、銘柄を中心に投資します。
- (ロ) 組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (ハ) 公社債の組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ニ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載した三井住友DS・新興国債インデックス・ファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

ロ 投資対象とする有価証券

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載した三井住友DS・新興国債インデックス・ファンドが投資対象とする有価証券の各号に掲げるものに投資します。

八 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 八 投資対象とする金融商品」において記載した三井住友DS・新興国債インデックス・ファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- (イ) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- (ロ) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- (ハ) 投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- (ニ) 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。

(Jリート・インデックス・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

- (イ) 東証REIT指数(配当込み)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
- (ロ) 不動産投資信託(REIT)への投資にあたっては、東証REIT指数採用銘柄(採用予定を含みます。)に投資を行うものとします。
- (ハ) 不動産投資信託(REIT)の組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ニ) 東証REIT指数先物取引等を活用することがあります。このため不動産投資信託への投資総額と東証REIT指数先物取引等の買建玉の投資総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- (ホ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

1. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。)
2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
3. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券または証書の性質を有するものの
4. 投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
5. 投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 八 投資対象とする金融商品」において記載した三井住友DS・国内リートインデックス・ファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

(ロ) 株式への投資は行いません。

(ハ) 外貨建資産への投資は行いません。

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

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

(外国リート・インデックス・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

日本を除く世界各国の不動産投資信託(REIT)などを主要投資対象とし、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

(イ) S & P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。

(ロ) 不動産投資信託(REIT)などへの投資にあたっては、S & P先進国REIT指数(除く日本)採用銘柄(採用予定を含みます。)に投資を行うものとします。

(ハ) 不動産投資信託(REIT)の組入比率は、原則として高位を保ちます。

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

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

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

1. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。)

2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

八 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 八 投資対象とする金融商品」において記載した三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

(ロ) 株式への投資は行いません。

(ハ) 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

(ゴールド・インデックス・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

L B M A金価格(円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

(イ) 主として別に定める金地金価格との連動を目指す投資信託証券に投資することにより、ロンドン貴金属市場協会(L B M A)金価格(円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

別に定める金地金価格との連動を目指す投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い、商品性及び運用上の効率性を損なわない範囲で、委託会社の判断により見直しを行うことがあります。

別に定める金地金価格との連動を目指す投資信託証券とは、下記のものとします。

iShares Gold Trust

SPDR Gold MiniShares Trust

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

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

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載した三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)が投資対象とする資産の種類に同じです。

ロ 投資対象とする有価証券

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載した三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)が投資対象とする有価証券の各号に掲げるものに投資します。

ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載した三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)が投資対象とする金融商品に同じです。

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

(ロ) 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) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(ニ) 同一銘柄の投資信託証券への投資割合には、原則として制限を設けません。ただし、当該投資信託証券が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割合は、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。

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。

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

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

（イ）株式市場リスク

内外の経済動向や株式市場での需給動向等の影響により株式相場が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、個々の株式の価格はその発行企業の事業活動や財務状況等によって変動し、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

（ロ）債券市場リスク

一般に債券は内外の経済情勢等の影響による金利の変動を受けて価格が変動します。通常、金利が上昇すると債券価格は下落し、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、債券の種類や特定の銘柄に関わる格付け等の違い、利払い等の仕組みの違いなどにより、価格の変動度合いが大きくなる場合と小さくなる場合があります。

（ハ）不動産投資信託（リート）に関するリスク

リートの価格は、不動産市況や金利・景気動向、関連法制度の変更等の影響を受け変動します。また、リートに組み入れられている個々の不動産等の市場価値や賃貸収入、個々のリートの事業活動や財務状況等によっても価格が変動します。これらにより、ファンドが組み入れているリートの価格が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

（ニ）金に関するリスク

ファンドは金の指標価格に連動することを目指した上場投資信託証券に投資します。一般に、金価格は、金の需給の変化や為替・金利動向等の様々な要因の影響を受けて変動します。金価格が下落した場合、組入上場投資信託証券の価格も下がり、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

（ホ）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。

（ヘ）為替変動リスク

（為替ヘッジなし）「各ファンド（ゴールドインデックスヘッジ有を除く）」

外貨建資産への投資は為替変動の影響を受けます。ファンドが保有する外貨建資産の価格が現地通貨ベースで上昇する場合であっても、当該現地通貨が対円で下落する（円高となる）場合、円ベースでの評価額が下落し、基準価額が下落することがあります。

（為替ヘッジあり）「ゴールドインデックスヘッジ有」

原則として対円での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。ただし、完全に為替変動リスクを回避することはできません。なお、円金利がヘッジ対象通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当分のヘッジコストがかかることにご留意ください。

（ト）カントリーリスク

海外に投資を行う場合には、投資先の国の政治・経済・社会状況の不安定化、取引規制や税制の変更等によって投資した資金の回収が困難になることや、その影響により投資する有価証券の価格が大きく変動することがあり、基準価額が下落する要因となります。

特に投資先が新興国の場合、その証券市場は先進国の証券市場に比べ、より運用上の制約が大きいことが想定されます。また、先進国に比べ、一般に市場規模が小さいため、有価証券の需給変動の影響を受けやすく、価格形成が偏ったり、変動性が大きくなる傾向が考えられます。

（チ）流動性リスク

有価証券等を大量に売買しなければならない場合、あるいは市場を取り巻く外部環境に急激な変化があり、市場規模の縮小や市場の混乱が生じた場合等には、十分な数量の売買ができなかったり、通常よりも不利な価格での取引を余儀なくされることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

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

（リ）対象インデックスの動きと連動しない要因

各ファンドは、特定の指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いますが、以下の要因等

により、各対象インデックスの動きに連動しないことがあります。

- ・有価証券売買時のコスト、信託報酬やその他のファンド運営にかかる費用を負担すること
- ・追加設定・一部解約により組入有価証券の売買のタイミング差が生じること
- ・インデックス構成銘柄と組入有価証券との誤差が影響すること
- ・利用可能な指数先物と対象インデックスの動きに不一致が生じること
- ・「225インデックス」は、組入銘柄の配当金を受け取ること（対象インデックスは配当金を含まない指数です。）
- ・「ゴールドインデックスヘッジ有」は、金の指標価格と当該指標との連動を目指した上場投資信託証券の取引価格の動きに不一致が生じること

(ヌ) 外国税制に関する留意点

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

(ル) ファミリーファンド方式にかかる留意点

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

(ロ) 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。

(ワ) 収益分配金に関する留意事項

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



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

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

ロ 投資リスクの管理体制

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

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

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

さらに、流動性リスク管理について規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングやストレステストを実施するとともに、緊急時対応策等の策定や有効性の検証等を行います。なお、当該流動性リスクの適切な管理の実施等について、定期的には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。

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



〔 ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較 〕

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



■225インデックス（ベンチマーク:日経平均株価(日経225)）



※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。

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

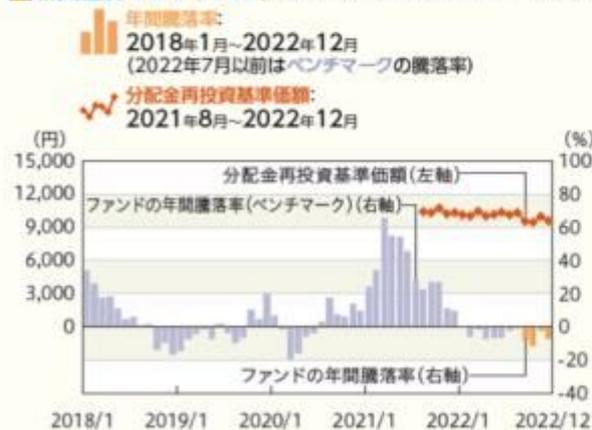


【 ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較 】

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



■新興国株インデックス（ベンチマーク:MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース））



※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。

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



ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較

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



■新興国債インデックス(ベンチマーク: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))



※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。

■Jリートインデックス（ベンチマーク:東証REIT指数(配当込み)）



【 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。



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



※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。

■ゴールドインデックスヘッジ有(ベンチマーク:LBMA金価格(円ヘッジ換算ベース))



※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J P X 総研または株式会社J P X 総研の関連会社が算出、公表する指数で、日本の株式を対象としています。
先進国株	MSCIコクサイインデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、日本を除く世界の主要先進国の株式を対象としています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、新興国の株式を対象としています。
日本国債	NOMURA-BPI(国債) 野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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	J P 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】

純資産総額に以下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。

< 信託報酬率およびその配分 >

ファンド名	信託報酬率	配分（税抜き）		
		委託会社	販売会社	受託会社
TOPIXインデックス 225インデックス	年0.385% （税抜き0.35%）	年0.165%	年0.165%	年0.02%
先進国株インデックス 新興国株インデックス	年0.473% （税抜き0.43%）	年0.205%	年0.205%	年0.02%
先進国債インデックス	年0.297% （税抜き0.27%）	年0.125%	年0.125%	年0.02%
新興国債インデックス	年0.473% （税抜き0.43%）	年0.205%	年0.205%	年0.02%
Jリートインデックス	年0.385% （税抜き0.35%）	年0.165%	年0.165%	年0.02%
Gリートインデックス	年0.473% （税抜き0.43%）	年0.205%	年0.205%	年0.02%
ゴールドインデックス ヘッジ有	年0.385% （税抜き0.35%）	年0.165%	年0.165%	年0.02%
マザーファンドが投資対象とする投資信託	年0.25%程度*			
実質的な負担	ファンドの純資産総額に対して年0.635%（税抜き0.60%）程度*			
*マザーファンドが投資対象とする投資信託の運用管理費用は、管理費用が最大の投資信託の数値を用いています。なお、管理費用は年度によって異なることや実際の組入状況等により実質的な負担も変動します。 また、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。 投資対象とする投資信託の変更等に伴い、実質的な負担が変更となる場合があります。				

上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。

支払先	役務の内容
委託会社	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	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	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

(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、純資産総額に以下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、「新興国債インデックス」および「ゴールドインデックスヘッジ有」は各計算期末または信託終了のときに、その他のファンド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。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となる場合があります。

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。

ファンド名	監査料率
TOPIXインデックス 225インデックス	年0.0055% (税抜き0.005%)以内
先進国株インデックス	年0.0066% (税抜き0.006%)以内
新興国株インデックス	年0.0077% (税抜き0.007%)以内
先進国債インデックス	年0.0055% (税抜き0.005%)以内
新興国債インデックス	年0.0066% (税抜き0.006%)以内
Jリートインデックス	年0.0055% (税抜き0.005%)以内
Gリートインデックス ゴールドインデックスヘッジ有	年0.0066% (税抜き0.006%)以内

- ロ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、信託財産中から支弁します。
- ハ 有価証券の売買時の手数料、デリバティブ取引等に要する費用、および外国における資産の保管等に要する費用等(それらにかかる消費税等相当額を含みます。)は、信託財産中から支弁するものとします。

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

リートを実質的な主要投資対象とするファンドでは、株式と同様に取引所等の市場で売買される多数の銘柄のリートの中から、約款上の選定基準に従って適宜組入銘柄を選定して分散投資を行い、また売却を行いますので、組み入れるリートの銘柄や構成比は流動的となります。リートの多くは法人形態をとっており、その費用には、運用者等に支払う費用以外に、一般の会社と同じように多種多様なものがあり、また、国・地域によっては、開示する項目の基準が異なります。

したがって、委託会社において、ファンドが実質的に組み入れる様々なリートの費用等を網羅的に調査し、ファンドへの投資等のための参考になるような情報として、その上限額、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投資対象のリート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つたりすることから、あらかじめ具体的に記載することはできません。

(5)【課税上の取扱い】

イ 個別元本について

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

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。

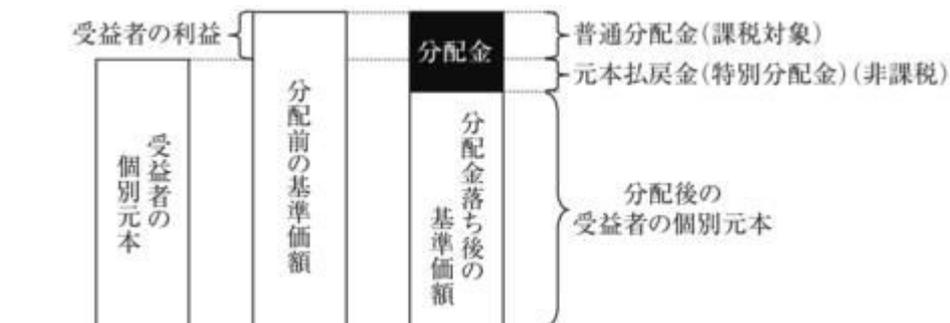
ハ 収益分配金の課税について

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

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12月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

2022年12月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	60,566,120	100.03
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	18,548	0.03
合計（純資産総額）		60,547,572	100.00

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

三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

2022年12月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	257,873,970	100.03
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	84,761	0.03
合計（純資産総額）		257,789,209	100.00

三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド

2022年12月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	284,670,610	100.04
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	126,849	0.04
合計（純資産総額）		284,543,761	100.00

三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド

2022年12月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	24,029,968	100.04
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	9,099	0.04
合計（純資産総額）		24,020,869	100.00

三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

2022年12月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	79,921,969	100.02
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	19,464	0.02
合計（純資産総額）		79,902,505	100.00

三井住友D S ・新興国債インデックス・ファンド

2022年12月30日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	12,555,846	98.59
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	180,049	1.41
合計（純資産総額）		12,735,895	100.00

三井住友D S ・国内リートインデックス・ファンド

2022年12月30日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	129,541,445	100.03
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	37,837	0.03
合計（純資産総額）		129,503,608	100.00

三井住友D S ・先進国リートインデックス・ファンド

2022年12月30日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	72,964,151	100.04
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	28,919	0.04
合計（純資産総額）		72,935,232	100.00

三井住友D S ・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）

2022年12月30日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	362,407,237	97.69
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	8,585,018	2.31
合計（純資産総額）		370,992,255	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	-	349,747,902	94.27

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

イ 主要投資銘柄

2022年12月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	18,624,841	3.4058	63,432,302	3.2519	60,566,120	100.03

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別投資比率

2022年12月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.03
合計	100.03

三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

イ 主要投資銘柄

2022年12月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	225マザーファンド	74,259,624	3.7116	275,621,419	3.4726	257,873,970	100.03

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別投資比率

2022年12月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.03
合計	100.03

三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド

イ 主要投資銘柄

2022年12月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	49,501,906	6.1207	302,986,698	5.7507	284,670,610	100.04

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12月30日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	100.04
合計	100.04

三井住友D S ・新興国株式インデックス・ファンド

イ 主要投資銘柄

2022年12月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	15,179,059	1.6419	24,922,971	1.5831	24,029,968	100.04

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12月30日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	100.04
合計	100.04

三井住友D S ・先進国債インデックス・ファンド

イ 主要投資銘柄

2022年12月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	42,057,554	1.9977	84,016,930	1.9003	79,921,969	100.02

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2022年12月30日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	100.02
合計	100.02

三井住友D S ・新興国債インデックス・ファンド

イ 主要投資銘柄

2022年12月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信 託受益証 券	米ドル建て新興国 債インデックス・ マザーファンド	14,112,450	0.9318	13,149,577	0.8897	12,555,846	98.59

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12月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.59
合計	98.59

三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド

イ 主要投資銘柄

2022年12月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信 託受益証 券	Jリート・イン デックス・マザー ファンド	49,729,911	2.6941	133,978,819	2.6049	129,541,445	100.03

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2022年12月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.03
合計	100.03

三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド

イ 主要投資銘柄

2022年12月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信 託受益証 券	外国リート・イン デックス・マザー ファンド	27,699,841	2.8053	77,706,197	2.6341	72,964,151	100.04

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12月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.04

合 計	100.04
-----	--------

三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

イ 主要投資銘柄

2022年12月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信 託受益証 券	ゴールド・イン デックス・マザー ファンド	307,933,756	1.1878	365,750,489	1.1769	362,407,237	97.69

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12月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.69
合 計	97.69

【投資不動産物件】

三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友D S ・国内リートインデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友D S ・先進国リートインデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友D S ・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

三井住友D S ・T O P I Xインデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友D S ・日経2 2 5インデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友D S ・先進国株式インデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友D S ・新興国株式インデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友D S ・先進国債インデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友D S ・新興国債インデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友D S ・国内リートインデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友D S ・先進国リートインデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

2022年12月30日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	売建	2,647,800.00	358,327,564	349,747,902	94.27

(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】

三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2021年11月30日)	6,046,349	6,046,349	10,294	10,294
第2期 (2022年11月30日)	61,728,569	61,728,569	10,830	10,830
2021年12月末日	7,859,748	-	10,650	-
2022年 1月末日	10,107,816	-	10,129	-
2月末日	13,550,573	-	10,079	-
3月末日	15,993,321	-	10,508	-
4月末日	17,148,322	-	10,253	-
5月末日	18,019,893	-	10,327	-
6月末日	19,836,530	-	10,113	-
7月末日	34,177,319	-	10,483	-
8月末日	44,818,475	-	10,603	-
9月末日	48,813,534	-	10,016	-
10月末日	57,694,445	-	10,524	-
11月末日	61,728,569	-	10,830	-
12月末日	60,547,572	-	10,332	-

三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2021年11月30日)	69,516,804	69,516,804	10,362	10,362
第2期 (2022年11月30日)	272,425,967	272,425,967	10,597	10,597
2021年12月末日	79,434,697	-	10,740	-
2022年 1月末日	76,494,806	-	10,067	-

2月末日	80,176,655	-	9,894	-
3月末日	108,835,659	-	10,461	-
4月末日	105,786,864	-	10,092	-
5月末日	111,435,980	-	10,257	-
6月末日	95,590,815	-	9,928	-
7月末日	170,027,443	-	10,455	-
8月末日	207,376,259	-	10,566	-
9月末日	210,108,450	-	9,833	-
10月末日	254,004,157	-	10,453	-
11月末日	272,425,967	-	10,597	-
12月末日	257,789,209	-	9,898	-

三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2021年11月30日)	74,584,829	74,584,829	10,652	10,652
第2期 (2022年11月30日)	309,023,748	309,023,748	11,100	11,100
2021年12月末日	103,818,923	-	11,078	-
2022年 1月末日	100,669,920	-	10,296	-
2月末日	103,752,165	-	10,222	-
3月末日	128,047,786	-	11,306	-
4月末日	124,108,639	-	10,815	-
5月末日	139,621,891	-	10,780	-
6月末日	126,561,355	-	10,522	-
7月末日	184,069,131	-	10,929	-
8月末日	242,421,778	-	10,994	-
9月末日	255,478,229	-	10,448	-
10月末日	319,206,849	-	11,442	-
11月末日	309,023,748	-	11,100	-
12月末日	284,543,761	-	10,412	-

三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2021年11月30日)	3,024,503	3,024,503	10,217	10,217
第2期 (2022年11月30日)	22,496,244	22,496,244	9,972	9,972
2021年12月末日	9,613,321	-	10,327	-
2022年 1月末日	9,483,195	-	10,122	-
2月末日	9,434,281	-	10,018	-
3月末日	9,882,827	-	10,448	-
4月末日	9,565,386	-	10,024	-

5月末日	9,786,793	-	10,143	-
6月末日	10,692,756	-	10,366	-
7月末日	12,501,382	-	10,116	-
8月末日	18,792,959	-	10,317	-
9月末日	27,505,993	-	9,533	-
10月末日	27,724,613	-	9,456	-
11月末日	22,496,244	-	9,972	-
12月末日	24,020,869	-	9,567	-

三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2021年11月30日)	6,787,059	6,787,059	10,037	10,037
第2期 (2022年11月30日)	80,135,860	80,135,860	10,037	10,037
2021年12月末日	16,956,219	-	10,090	-
2022年 1月末日	17,786,215	-	9,914	-
2月末日	7,916,507	-	9,721	-
3月末日	8,289,258	-	10,039	-
4月末日	8,415,328	-	10,058	-
5月末日	8,453,852	-	9,995	-
6月末日	11,764,755	-	10,226	-
7月末日	25,681,595	-	10,286	-
8月末日	32,524,384	-	10,159	-
9月末日	35,150,749	-	10,064	-
10月末日	59,970,450	-	10,349	-
11月末日	80,135,860	-	10,037	-
12月末日	79,902,505	-	9,542	-

三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2021年11月30日)	1,607,853	1,607,853	9,918	9,918
第2期 (2022年11月30日)	11,569,350	11,569,350	9,187	9,187
2021年12月末日	1,664,115	-	10,123	-
2022年 1月末日	6,510,596	-	9,745	-
2月末日	6,202,436	-	9,096	-
3月末日	6,211,245	-	8,922	-
4月末日	6,208,027	-	8,885	-
5月末日	6,205,131	-	8,847	-
6月末日	6,738,227	-	8,865	-
7月末日	9,260,324	-	9,118	-

8月末日	10,337,423	-	9,293	-
9月末日	10,965,206	-	9,000	-
10月末日	11,387,535	-	9,260	-
11月末日	11,569,350	-	9,187	-
12月末日	12,735,895	-	8,780	-

三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2021年11月30日)	2,142,283	2,142,283	9,513	9,513
第2期 (2022年11月30日)	118,055,864	118,055,864	9,600	9,600
2021年12月末日	12,863,551	-	9,829	-
2022年 1月末日	12,764,090	-	9,296	-
2月末日	3,583,145	-	8,992	-
3月末日	4,451,396	-	9,601	-
4月末日	5,009,757	-	9,485	-
5月末日	5,752,848	-	9,648	-
6月末日	6,680,661	-	9,485	-
7月末日	27,600,300	-	9,757	-
8月末日	55,184,057	-	9,862	-
9月末日	53,211,128	-	9,453	-
10月末日	78,629,032	-	9,607	-
11月末日	118,055,864	-	9,600	-
12月末日	129,503,608	-	9,259	-

三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2021年11月30日)	2,304,754	2,304,754	10,763	10,763
第2期 (2022年11月30日)	86,933,845	86,933,845	10,597	10,597
2021年12月末日	13,257,696	-	11,446	-
2022年 1月末日	13,309,621	-	10,644	-
2月末日	4,868,061	-	10,615	-
3月末日	8,684,683	-	11,911	-
4月末日	10,863,045	-	12,104	-
5月末日	12,370,092	-	11,194	-
6月末日	14,800,203	-	10,923	-
7月末日	31,378,532	-	11,486	-
8月末日	62,961,309	-	11,221	-
9月末日	60,685,807	-	9,992	-
10月末日	69,646,483	-	10,862	-

11月末日	86,933,845	-	10,597	-
12月末日	72,935,232	-	9,934	-

三井住友D S ・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2021年11月30日)	37,563,029	37,563,029	9,748	9,748
第2期 (2022年11月30日)	335,482,332	335,482,332	9,277	9,277
2021年12月末日	37,547,795	-	9,835	-
2022年 1月末日	37,732,406	-	9,738	-
2月末日	62,137,638	-	10,282	-
3月末日	94,415,667	-	10,488	-
4月末日	98,116,532	-	10,231	-
5月末日	98,249,146	-	10,035	-
6月末日	98,317,058	-	9,826	-
7月末日	201,552,282	-	9,467	-
8月末日	303,012,975	-	9,277	-
9月末日	317,170,668	-	8,899	-
10月末日	319,678,955	-	8,778	-
11月末日	335,482,332	-	9,277	-
12月末日	370,992,255	-	9,557	-

【分配の推移】

三井住友D S ・ T O P I X インデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日 ~ 2021年11月30日	0
第2期	2021年12月 1日 ~ 2022年11月30日	0

三井住友D S ・ 日経 2 2 5 インデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日 ~ 2021年11月30日	0
第2期	2021年12月 1日 ~ 2022年11月30日	0

三井住友D S ・ 先進国株式インデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日 ~ 2021年11月30日	0
第2期	2021年12月 1日 ~ 2022年11月30日	0

三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0
第2期	2021年12月 1日～2022年11月30日	0

三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0
第2期	2021年12月 1日～2022年11月30日	0

三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0
第2期	2021年12月 1日～2022年11月30日	0

三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0
第2期	2021年12月 1日～2022年11月30日	0

三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0
第2期	2021年12月 1日～2022年11月30日	0

三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0
第2期	2021年12月 1日～2022年11月30日	0

【収益率の推移】

三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	2.9
第2期	5.2

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

三井住友D S・日経225インデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	3.6
第2期	2.3

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

三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	6.5
第2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。

三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	2.2
第2期	2.4

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

三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	0.4
第2期	0.0

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

三井住友D S・新興国債インデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	0.8
第2期	7.4

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

三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	4.9
第2期	0.9

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

三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	7.6
第2期	1.5

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

三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

	収益率(%)
第1期	2.5
第2期	4.8

(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。

(4) 【設定及び解約の実績】

三井住友D S・TOPIXインデックス・ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	11,131,313	5,257,925
第2期	52,125,564	1,000,000

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友D S・日経225インデックス・ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	68,267,713	1,179,562
第2期	221,907,962	31,922,134

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	72,990,426	2,971,998
第2期	270,552,214	62,163,465

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友D S ・新興国株式インデックス・ファンド

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2,960,151	0
第2期	29,976,495	10,377,413

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友D S ・先進国債インデックス・ファンド

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	6,762,046	0
第2期	86,535,230	13,454,513

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友D S ・新興国債インデックス・ファンド

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	1,621,093	0
第2期	10,979,714	8,229

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友D S ・国内リートインデックス・ファンド

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2,350,609	98,727
第2期	132,574,732	11,855,664

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友D S ・先進国リートインデックス・ファンド

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2,141,454	0
第2期	90,161,002	10,267,851

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友D S ・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	38,535,757	0
第2期	379,344,235	56,234,121

（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12月30日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	211,581,051,260	98.76
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	2,661,167,518	1.24
合計（純資産総額）		214,242,218,778	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	2,648,100,000	1.24
合計	買建	-	2,648,100,000	1.24

2.2.5 マザーファンド

2022年12月30日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	125,736,397,050	96.82
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	4,133,404,266	3.18
合計（純資産総額）		129,869,801,316	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	4,120,640,000	3.17
合計	買建	-	4,120,640,000	3.17

外国株式インデックス・マザーファンド

2022年12月30日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	276,920,567,181	66.23
	イギリス	18,150,250,371	4.34
	カナダ	15,287,932,696	3.66
	スイス	14,012,859,555	3.35
	フランス	13,650,701,363	3.26
	ドイツ	10,064,359,341	2.41
	オーストラリア	8,809,996,198	2.11
	オランダ	7,665,436,676	1.83
	アイルランド	7,561,387,545	1.81
	スウェーデン	3,858,864,813	0.92
	デンマーク	3,685,968,179	0.88
	スペイン	3,074,428,500	0.74
	香港	2,775,935,962	0.66
	イタリア	2,165,440,218	0.52
ジャージー	1,668,886,081	0.40	

	フィンランド	1,607,229,907	0.38
	シンガポール	1,465,356,836	0.35
	ベルギー	1,061,149,554	0.25
	ノルウェー	963,940,879	0.23
	イスラエル	896,141,839	0.21
	ケイマン諸島	823,671,874	0.20
	バミューダ	669,165,606	0.16
	オランダ領キュ ラソー	664,355,917	0.16
	ルクセンブルグ	316,898,748	0.08
	ニュージーラン ド	294,075,184	0.07
	オーストリア	239,453,243	0.06
	ポルトガル	239,142,850	0.06
	リベリア	106,376,380	0.03
	マン島	89,678,497	0.02
	パナマ	74,781,704	0.02
	小計	398,864,433,697	95.39
投資証券	アメリカ	8,166,978,399	1.95
	オーストラリア	834,763,210	0.20
	香港	194,094,292	0.05
	シンガポール	191,030,922	0.05
	イギリス	168,895,704	0.04
	フランス	152,582,089	0.04
	ベルギー	53,871,628	0.01
	カナダ	49,507,323	0.01
	小計	9,811,723,567	2.35
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	9,443,369,469	2.26
合計（純資産総額）		418,119,526,733	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	444,118,400	0.11
株価指数先物取引	買建	ドイツ	1,466,275,717	0.35
株価指数先物取引	買建	アメリカ	7,270,004,333	1.74
株価指数先物取引	買建	オーストラリア	358,510,642	0.09
合計	買建	-	9,538,909,092	2.28

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	-	2,182,028,860	0.52

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2022年12月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
株式	ケイマン諸島	4,356,963,331	16.51

	インド	3,400,771,945	12.89
	台湾	3,123,699,055	11.84
	韓国	2,659,076,513	10.08
	中国	1,623,603,707	6.15
	ブラジル	1,179,403,449	4.47
	南アフリカ	844,884,504	3.20
	タイ	520,681,739	1.97
	インドネシア	443,696,885	1.68
	メキシコ	430,247,187	1.63
	マレーシア	364,883,675	1.38
	香港	275,752,239	1.05
	フィリピン	173,110,867	0.66
	トルコ	155,728,483	0.59
	ポーランド	153,826,736	0.58
	チリ	128,453,527	0.49
	バミューダ	121,593,431	0.46
	アメリカ	107,477,085	0.41
	ギリシャ	69,702,298	0.26
	ハンガリー	38,310,780	0.15
	チェコ	31,250,066	0.12
	コロンビア	26,563,407	0.10
	エジプト	19,033,519	0.07
	ルクセンブルグ	18,035,661	0.07
	オランダ	15,203,938	0.06
	シンガポール	6,660,181	0.03
	ペルー	6,016,355	0.02
	小計	20,294,630,563	76.92
投資信託受益証券	香港	1,212,261,495	4.59
投資証券	アメリカ	1,714,798,299	6.50
	メキシコ	116,070,233	0.44
	ブラジル	44,176,537	0.17
	南アフリカ	10,913,984	0.04
	小計	1,885,959,053	7.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	2,990,148,900	11.34
合計(純資産総額)		26,383,000,011	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	3,026,618,946	11.47
合計	買建	-	3,026,618,946	11.47

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	-	122,677,107	0.46

外国債券パッシブ・マザーファンド

2022年12月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	74,374,044,614	50.69
	フランス	12,515,137,056	8.53
	イタリア	11,040,739,475	7.52
	ドイツ	9,848,835,188	6.71
	スペイン	7,370,057,407	5.02
	イギリス	6,796,774,400	4.63
	中国	5,346,102,743	3.64
	カナダ	2,987,815,172	2.04
	ベルギー	2,774,884,111	1.89
	オランダ	2,353,210,848	1.60
	オーストラリア	2,324,636,588	1.58
	オーストリア	1,692,524,657	1.15
	メキシコ	1,230,859,053	0.84
	アイルランド	911,143,901	0.62
	マレーシア	797,133,735	0.54
	フィンランド	719,307,185	0.49
	シンガポール	703,706,577	0.48
	ポーランド	650,993,659	0.44
	イスラエル	503,931,507	0.34
	デンマーク	494,778,215	0.34
ニュージーランド	316,525,796	0.22	
ノルウェー	303,190,369	0.21	
スウェーデン	290,325,603	0.20	
	小計	146,346,657,859	99.74
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	378,138,042	0.26
合計(純資産総額)		146,724,795,901	100.00

米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

2022年12月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	カタール	277,332,516	8.94
	アラブ首長国連邦	275,844,153	8.89
	サウジアラビア	275,392,575	8.88
	メキシコ	257,617,675	8.30
	チリ	195,438,171	6.30
	ブラジル	193,049,704	6.22
	オマーン	187,305,784	6.04
	ドミニカ共和国	179,669,430	5.79
	パナマ	175,762,211	5.66
	南アフリカ	149,872,308	4.83
	トルコ	146,153,656	4.71

	ペルー	141,306,922	4.55
	中国	129,765,472	4.18
	インドネシア	122,455,825	3.95
	ウルグアイ	104,100,496	3.36
	フィリピン	62,369,530	2.01
	コロンビア	59,585,219	1.92
	小計	2,933,021,647	94.53
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	169,742,953	5.47
合計(純資産総額)		3,102,764,600	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	-	30,498,368	0.98

Jリート・インデックス・マザーファンド

2022年12月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	日本	10,839,325,900	98.75
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	136,851,701	1.25
合計(純資産総額)		10,976,177,601	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	37,500,000	0.34
合計	買建	-	37,500,000	0.34

外国リート・インデックス・マザーファンド

2022年12月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	17,817,912,017	74.83
	オーストラリア	1,533,797,315	6.44
	イギリス	1,091,435,294	4.58
	シンガポール	856,923,162	3.60
	カナダ	430,304,647	1.81
	フランス	410,290,064	1.72
	香港	342,176,888	1.44
	ベルギー	253,211,980	1.06
	スペイン	103,446,811	0.43
	ニュージーランド	95,409,220	0.40
	韓国	57,081,203	0.24
	オランダ	44,597,997	0.19
	イスラエル	32,049,816	0.13
	ガーンジィ	27,099,737	0.11
	ドイツ	10,534,806	0.04

	アイルランド	8,218,911	0.03
	イタリア	2,144,922	0.01
	小計	23,116,634,790	97.08
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	695,691,852	2.92
合計（純資産総額）		23,812,326,642	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	-	75,440,163	0.32

ゴールド・インデックス・マザーファンド

2022年12月30日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	アメリカ	4,025,685,769	97.90
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	86,286,765	2.10
合計（純資産総額）		4,111,972,534	100.00

（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12月30日現在

国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価（円）	帳簿価額（円）	評価額単価（円）	評価額（円）	投資比率（％）
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	4,262,100	2,006.51	8,551,954,800	1,812.50	7,725,056,250	3.61
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	549,100	11,231.46	6,167,195,700	10,035.00	5,510,218,500	2.57
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	4,851,600	755.10	3,663,443,160	889.00	4,313,072,400	2.01
日本	株式	キーエンス	電気機器	77,600	57,022.59	4,424,953,000	51,420.00	3,990,192,000	1.86
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	997,500	3,819.17	3,809,617,700	3,762.00	3,752,595,000	1.75
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	558,200	4,686.02	2,615,734,300	5,296.00	2,956,227,200	1.38
日本	株式	第一三共	医薬品	678,100	4,511.49	3,059,244,400	4,250.00	2,881,925,000	1.35
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	688,800	4,051.34	2,790,564,600	4,111.00	2,831,656,800	1.32
日本	株式	任天堂	その他製品	490,100	5,888.51	2,885,956,600	5,532.00	2,711,233,200	1.27
日本	株式	日立製作所	電気機器	393,500	7,287.05	2,867,452,500	6,691.00	2,632,908,500	1.23
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	450,200	5,945.03	2,676,450,900	5,644.00	2,540,928,800	1.19
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	590,700	4,327.33	2,556,156,300	4,177.00	2,467,353,900	1.15
日本	株式	KDDI	情報・通信業	601,600	4,108.71	2,471,799,000	3,982.00	2,395,571,200	1.12
日本	株式	三井物産	卸売業	600,800	3,980.89	2,391,717,600	3,853.00	2,314,882,400	1.08

日本	株式	三菱商事	卸売業	513,400	4,597.85	2,360,533,700	4,283.00	2,198,892,200	1.03
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	769,400	2,827.41	2,175,411,800	2,827.50	2,175,478,500	1.02
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	54,800	44,952.99	2,463,423,600	38,880.00	2,130,624,000	0.99
日本	株式	信越化学工業	化学	131,100	17,561.90	2,302,365,400	16,225.00	2,127,097,500	0.99
日本	株式	H O Y A	精密機器	165,800	14,047.64	2,329,099,000	12,705.00	2,106,489,000	0.98
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	505,700	4,284.13	2,166,483,600	4,146.00	2,096,632,200	0.98
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,104,100	1,719.95	1,899,000,100	1,856.00	2,049,209,600	0.96
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	630,900	3,349.11	2,112,953,100	3,032.00	1,912,888,800	0.89
日本	株式	ダイキン工業	機械	93,600	22,361.90	2,093,074,300	20,200.00	1,890,720,000	0.88
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,250,600	1,497.53	1,872,811,450	1,488.00	1,860,892,800	0.87
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	84,500	19,711.07	1,665,585,200	19,160.00	1,619,020,000	0.76
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	283,100	5,580.35	1,579,797,700	5,660.00	1,602,346,000	0.75
日本	株式	村田製作所	電気機器	235,200	7,446.08	1,751,316,900	6,588.00	1,549,497,600	0.72
日本	株式	ファナック	電気機器	76,200	20,355.70	1,551,104,200	19,835.00	1,511,427,000	0.71
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	745,900	2,125.77	1,585,610,200	2,006.50	1,496,648,350	0.70
日本	株式	S M C	機械	25,400	61,639.94	1,565,654,500	55,580.00	1,411,732,000	0.66

□ 種別・業種別投資比率

2022年12月30日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式(国内)	水産・農林業	0.10
	鉱業	0.31
	建設業	1.95
	食料品	3.48
	繊維製品	0.46
	パルプ・紙	0.18
	化学	6.05
	医薬品	5.73
	石油・石炭製品	0.48
	ゴム製品	0.71
	ガラス・土石製品	0.69
	鉄鋼	0.76
	非鉄金属	0.73
	金属製品	0.55
	機械	4.97
	電気機器	16.35
	輸送用機器	7.21
	精密機器	2.55
	その他製品	2.32
電気・ガス業	1.26	
陸運業	3.10	

海運業	0.63
空運業	0.52
倉庫・運輸関連業	0.14
情報・通信業	8.84
卸売業	5.97
小売業	4.71
銀行業	6.38
証券、商品先物取引業	0.74
保険業	2.52
その他金融業	1.12
不動産業	1.95
サービス業	5.30
合計	98.76

2.2.5 マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2022年12月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	165,000	80,623.66	13,302,904,360	80,530.00	13,287,450,000	10.23
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	165,000	40,997.88	6,764,650,560	38,880.00	6,415,200,000	4.94
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	990,000	6,766.82	6,699,156,240	5,644.00	5,587,560,000	4.30
日本	株式	KDDI	情報・通信業	990,000	4,250.23	4,207,730,160	3,982.00	3,942,180,000	3.04
日本	株式	ダイキン工業	機械	165,000	21,659.64	3,573,841,280	20,200.00	3,333,000,000	2.57
日本	株式	ファナック	電気機器	165,000	19,830.48	3,272,028,980	19,835.00	3,272,775,000	2.52
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	330,000	8,232.69	2,716,786,400	8,480.00	2,798,400,000	2.15
日本	株式	信越化学工業	化学	165,000	16,064.33	2,650,613,860	16,225.00	2,677,125,000	2.06
日本	株式	テルモ	精密機器	660,000	4,253.15	2,807,077,280	3,746.00	2,472,360,000	1.90
日本	株式	京セラ	電気機器	330,000	6,755.56	2,229,334,600	6,552.00	2,162,160,000	1.66
日本	株式	TDK	電気機器	495,000	4,809.25	2,380,576,680	4,335.00	2,145,825,000	1.65
日本	株式	第一三共	医薬品	495,000	4,589.85	2,271,976,500	4,250.00	2,103,750,000	1.62
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	495,000	4,472.70	2,213,986,320	4,177.00	2,067,615,000	1.59
日本	株式	中外製薬	医薬品	495,000	3,367.64	1,666,983,600	3,368.00	1,667,160,000	1.28
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	165,000	10,984.78	1,812,488,640	10,035.00	1,655,775,000	1.27
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	825,000	2,068.19	1,706,258,600	2,006.50	1,655,362,500	1.27
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・データ	情報・通信業	825,000	1,895.70	1,563,948,400	1,932.00	1,593,900,000	1.23
日本	株式	オリンパス	精密機器	660,000	2,943.22	1,942,527,440	2,352.00	1,552,320,000	1.20
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	825,000	1,952.73	1,611,003,200	1,812.50	1,495,312,500	1.15
日本	株式	エーザイ	医薬品	165,000	8,538.40	1,408,835,180	8,704.00	1,436,160,000	1.11
日本	株式	エムスリー	サービス業	396,000	4,084.77	1,617,569,520	3,578.00	1,416,888,000	1.09

日本	株式	バンダイナムコホールディングス	その他製品	165,000	9,358.51	1,544,153,940	8,314.00	1,371,810,000	1.06
日本	株式	日東電工	化学	165,000	8,237.67	1,359,215,820	7,650.00	1,262,250,000	0.97
日本	株式	セコム	サービス業	165,000	8,213.73	1,355,265,700	7,543.00	1,244,595,000	0.96
日本	株式	キッコーマン	食料品	165,000	7,809.00	1,288,485,480	6,940.00	1,145,100,000	0.88
日本	株式	富士フイルムホールディングス	化学	165,000	6,799.84	1,121,974,380	6,625.00	1,093,125,000	0.84
日本	株式	塩野義製薬	医薬品	165,000	6,631.03	1,094,119,300	6,586.00	1,086,690,000	0.84
日本	株式	デンソー	輸送用機器	165,000	7,223.94	1,191,950,380	6,536.00	1,078,440,000	0.83
日本	株式	資生堂	化学	165,000	5,153.67	850,355,120	6,471.00	1,067,715,000	0.82
日本	株式	オムロン	電気機器	165,000	6,731.99	1,110,778,280	6,405.00	1,056,825,000	0.81

□ 種類別・業種別投資比率

2022年12月30日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式（国内）	水産・農林業	0.07
	鉱業	0.07
	建設業	1.65
	食料品	3.52
	繊維製品	0.14
	パルプ・紙	0.08
	化学	6.83
	医薬品	7.70
	石油・石炭製品	0.21
	ゴム製品	0.73
	ガラス・土石製品	0.91
	鉄鋼	0.08
	非鉄金属	0.86
	金属製品	0.02
	機械	5.13
	電気機器	21.41
	輸送用機器	4.22
	精密機器	4.13
	その他製品	2.68
	電気・ガス業	0.16
	陸運業	1.39
	海運業	0.35
	空運業	0.04
	倉庫・運輸関連業	0.19
	情報・通信業	11.32
	卸売業	2.68
	小売業	11.96
銀行業	0.71	
証券、商品先物取引業	0.24	

	保険業	0.94
	その他金融業	0.73
	不動産業	1.10
	サービス業	4.57
合計		96.82

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12月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,054,286	18,758.60	19,776,929,763	17,199.25	18,132,925,322	4.34
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	464,896	31,954.55	14,855,544,406	31,982.03	14,868,316,424	3.56
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	602,062	12,283.75	7,395,578,617	11,170.69	6,725,445,554	1.61
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CLASS A	メディア・娯楽	393,109	12,656.03	4,975,199,325	11,737.32	4,614,044,162	1.10
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	61,503	70,156.37	4,314,827,475	70,315.08	4,324,588,119	1.03
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CLASS C	メディア・娯楽	364,632	12,681.60	4,624,117,703	11,803.67	4,303,993,976	1.03
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	172,374	23,375.74	4,029,370,208	23,562.21	4,061,512,731	0.97
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	273,689	14,671.16	4,015,334,859	14,490.84	3,965,983,508	0.95
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CLASS B	各種金融	85,606	41,840.32	3,581,782,662	41,012.26	3,510,895,700	0.84
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	192,967	18,128.68	3,498,237,898	17,678.29	3,411,327,358	0.82
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	157,042	19,321.36	3,034,265,449	20,248.69	3,179,895,246	0.76
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	163,845	20,804.41	3,408,698,730	19,378.18	3,175,018,065	0.76
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	107,641	27,776.41	2,989,880,767	27,609.56	2,971,920,863	0.71

アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	122,445	24,033.36	2,942,764,396	23,663.06	2,897,423,871	0.69
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	67,414	41,965.37	2,829,053,207	42,518.41	2,866,335,889	0.69
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・ 自動車部品	175,137	24,079.63	4,217,233,685	16,165.51	2,831,179,625	0.68
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・ タバコ	181,084	15,994.35	2,896,320,672	15,561.29	2,817,901,072	0.67
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	ソフトウェア・ サービス	56,567	45,583.37	2,578,514,561	46,207.47	2,613,817,785	0.63
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	52,951	48,329.02	2,559,070,030	48,703.55	2,578,901,887	0.62
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	116,516	21,007.02	2,447,654,152	21,571.71	2,513,449,595	0.60
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	367,956	6,569.98	2,417,464,111	6,811.49	2,506,328,982	0.60
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	166,087	14,448.37	2,399,686,446	14,705.81	2,442,444,529	0.58
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・ エンターテインメント	150,392	14,565.30	2,190,504,601	15,958.50	2,400,031,032	0.57
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・ タバコ	269,354	8,295.14	2,234,330,131	8,486.17	2,285,782,487	0.55
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・ タバコ	90,481	24,240.38	2,193,293,627	24,148.75	2,185,002,686	0.52
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	476,685	4,914.11	2,342,482,082	4,397.68	2,096,307,137	0.50
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・ 半導体製造装置	26,475	69,297.39	1,834,648,367	74,021.39	1,959,716,220	0.47
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・ 半導体製造装置	26,717	79,201.60	2,116,029,233	73,097.55	1,952,947,216	0.47

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	46,348	44,443.35	2,059,860,573	42,094.26	1,950,984,716	0.47
デンマー ク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・ バイオテ クノロ ジー・ラ イフサイ エンス	108,265	16,738.15	1,812,155,394	17,895.92	1,937,501,562	0.46

□ 種類別・業種別投資比率

2022年12月30日現在

種類	業種	投資比率（%）
株式（外国）	エネルギー	5.81
	素材	4.40
	資本財	6.64
	商業・専門サービス	1.21
	運輸	1.81
	自動車・自動車部品	1.50
	耐久消費財・アパレル	1.61
	消費者サービス	1.86
	小売	4.29
	食品・生活必需品小売り	1.51
	食品・飲料・タバコ	4.42
	家庭用品・パーソナル用品	1.89
	ヘルスケア機器・サービス	5.00
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイ エンス	9.53
	銀行	5.98
	各種金融	4.74
	保険	3.40
	不動産	0.34
	ソフトウェア・サービス	10.21
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.76
半導体・半導体製造装置	4.16	
電気通信サービス	1.43	
公益事業	3.26	
メディア・娯楽	4.65	
投資証券	-	2.35
合計		97.74

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12月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・ 半導体製 造装置	687,000	2,103.84	1,445,339,906	1,924.80	1,322,339,111	5.01
香港	投資信 託受益 証券	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	-	1,606,600	754.1113	1,211,555,265	754.5509	1,212,261,495	4.59
ケイマン 諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディ ア・娯楽	174,600	4,869.03	850,132,570	5,705.10	996,111,158	3.78
アメリカ	投資証 券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	-	187,900	5,201.88	977,432,709	5,061.18	950,995,346	3.60
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	133,362	6,415.39	855,569,880	5,834.15	778,053,912	2.95
ケイマン 諸島	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	小売	413,400	1,342.59	555,028,065	1,456.06	601,935,617	2.28
ケイマン 諸島	株式	MEITUAN-CLASS B	小売	123,200	2,662.20	327,982,967	3,128.28	385,403,603	1.46
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネル ギー	85,149	4,371.68	372,243,957	4,094.71	348,660,717	1.32
アメリカ	投資証 券	ISHARES MSCI UAE ETF	-	158,652	2,042.67	324,074,434	2,016.24	319,881,110	1.21
ブラジル	株式	VALE SA	素材	107,188	2,121.45	227,394,460	2,229.48	238,973,898	0.91
アメリカ	投資証 券	ISHARES MSCI QATAR ETF	-	93,365	2,704.96	252,549,016	2,468.22	230,445,360	0.87
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフト ウェア・ サービス	94,296	2,622.68	247,308,027	2,443.26	230,389,220	0.87
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	2,696,000	80.35	216,613,443	83.06	223,923,289	0.85
ケイマン 諸島	株式	JD.COM INC - CL A	小売	60,135	3,604.39	216,749,887	3,710.36	223,122,498	0.85
アメリカ	投資証 券	ISHARES MSCI KUWAIT ETF	-	48,543	4,692.88	227,806,369	4,397.68	213,476,483	0.81
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	144,405	1,524.44	220,137,311	1,461.96	211,114,406	0.80
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	各種金融	48,367	4,295.66	207,768,185	4,307.39	208,335,725	0.79
ケイマン 諸島	株式	PINDUODUO INC- ADR	小売	14,166	10,465.17	148,249,657	10,935.81	154,916,641	0.59
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	176,500	805.41	142,154,286	862.91	152,304,321	0.58

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	347,800	431.94	150,229,732	430.28	149,649,745	0.57
南アフリ カ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	6,130	19,587.28	120,070,002	22,326.10	136,858,993	0.52
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフト ウェア・ サービス	25,670	5,474.01	140,517,744	5,262.69	135,093,188	0.51
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS- PREF	テクノロ ジー・ ハード ウェアお よび機器	22,945	5,815.56	133,437,990	5,327.75	122,245,223	0.46
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・ 半導体製 造装置	15,225	8,849.38	134,731,795	7,912.50	120,467,812	0.46
ケイマン 諸島	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディ ア・娯楽	61,500	1,678.02	103,198,172	1,872.20	115,140,300	0.44
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・ 半導体製 造装置	42,000	3,088.31	129,709,066	2,714.58	114,012,162	0.43
インドネ シア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	1,562,000	76.64	119,715,461	72.89	113,850,275	0.43
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	1,573,000	66.12	103,999,964	68.25	107,357,564	0.41
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	2,215,000	47.01	104,127,172	48.34	107,066,012	0.41
ケイマン 諸島	株式	NETEASE INC	メディ ア・娯楽	55,400	1,867.05	103,434,758	1,894.33	104,945,660	0.40

□ 種類別・業種別投資比率

2022年12月30日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式（外国）	エネルギー	3.79
	素材	6.36
	資本財	2.72
	商業・専門サービス	0.07
	運輸	1.63
	自動車・自動車部品	2.64
	耐久消費財・アパレル	1.36
	消費者サービス	1.30
	小売	6.88
	食品・生活必需品小売り	1.24
	食品・飲料・タバコ	2.60
	家庭用品・パーソナル用品	0.78
	ヘルスケア機器・サービス	0.67
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイ エンス	2.34

	銀行	10.13
	各種金融	2.63
	保険	2.25
	不動産	1.31
	ソフトウェア・サービス	2.15
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.65
	半導体・半導体製造装置	7.04
	電気通信サービス	2.03
	公益事業	2.38
	メディア・娯楽	5.99
投資信託受益証券	-	4.59
投資証券	-	7.15
合計		88.67

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12月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	14,950,000	12,334.86	1,844,062,033	12,232.68	1,828,786,272	1.625	2026/05/15	1.25
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	13,300,000	12,629.72	1,679,753,092	12,529.40	1,666,410,372	2.250	2026/03/31	1.14
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	9,000,000	12,760.96	1,148,486,652	12,566.82	1,131,014,043	2.875	2028/05/15	0.77
中国	国債 証券	CHINA GOVERNMENT BOND	51,000,000	1,902.90	970,480,069	1,907.94	973,050,068	2.690	2026/08/12	0.66
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	7,700,000	12,616.32	971,456,624	12,614.73	971,334,009	0.125	2024/02/15	0.66
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	8,500,000	11,140.56	946,947,863	10,864.95	923,520,342	1.125	2031/02/15	0.63
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	7,100,000	12,179.34	864,733,047	12,054.34	855,857,806	1.375	2026/08/31	0.58
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	6,500,000	12,876.01	836,940,890	12,863.54	836,130,093	2.125	2024/03/31	0.57
中国	国債 証券	CHINA GOVERNMENT BOND	43,000,000	1,923.36	827,046,178	1,924.58	827,569,495	3.020	2031/05/27	0.56
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	7,200,000	11,444.84	824,028,782	11,272.20	811,598,508	0.625	2027/12/31	0.55
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	7,500,000	10,806.69	810,501,742	10,543.68	790,775,887	0.625	2030/05/15	0.54
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	6,200,000	12,751.54	790,595,548	12,728.19	789,147,525	1.750	2024/06/30	0.54
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	7,000,000	10,924.93	764,744,792	10,654.08	745,785,943	0.875	2030/11/15	0.51
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,700,000	12,913.30	736,058,236	12,889.95	734,726,990	2.500	2024/05/15	0.50

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	10,751.75	752,622,647	10,481.71	733,719,532	0.625	2030/08/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,600,000	12,846.95	719,429,334	12,819.48	717,891,076	2.375	2024/08/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	12,625.08	719,629,446	12,278.86	699,895,230	2.875	2032/05/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	12,632.38	694,780,707	12,586.20	692,240,829	1.500	2024/10/31	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	11,705.07	702,304,134	11,498.19	689,891,376	1.375	2028/10/31	0.47
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,800,000	12,041.08	698,382,499	11,805.81	684,737,152	0.000	2030/08/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,900,000	11,500.71	678,541,943	11,317.32	667,721,850	0.750	2028/01/31	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,900,000	11,505.49	678,823,797	11,314.67	667,565,264	1.000	2028/07/31	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	13,001.42	663,072,175	12,993.85	662,686,416	2.750	2024/02/15	0.45
フランス	国債証券	FRANCE OAT.	4,800,000	13,710.42	658,100,331	13,686.94	656,973,098	0.000	2024/03/25	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	12,799.31	652,764,968	12,758.31	650,673,748	2.250	2024/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,200,000	12,432.80	646,505,376	12,396.04	644,593,965	0.750	2024/11/15	0.44
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	31,000,000	2,054.53	636,905,813	2,062.33	639,322,734	3.720	2051/04/12	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	11,502.30	632,626,681	11,214.34	616,788,936	1.625	2031/05/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	12,423.51	621,175,335	12,295.98	614,799,100	2.000	2026/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	12,345.21	617,260,685	12,115.78	605,788,770	2.375	2029/03/31	0.41

□ 種類別投資比率

2022年12月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	99.74
合計	99.74

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12月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
サウジアラビア	国債証券	SAUDI INTERNATIONAL BOND	1,600,000	11,635.92	186,174,649	10,816.38	173,062,032	2.250	2033/02/02	5.58

アラブ 首長国 連邦	国債 証券	ABU DHABI GOVT INT'L	1,300,000	11,823.10	153,700,305	11,019.28	143,250,578	1.875	2031/09/15	4.62
カタール	国債 証券	STATE OF QATAR	1,100,000	13,621.92	149,841,124	12,891.14	141,802,556	3.750	2030/04/16	4.57
オマーン	国債 証券	OMAN GOV INTERNTL BOND	1,000,000	13,345.19	133,451,878	13,392.22	133,922,167	6.250	2031/01/25	4.32
メキシコ	国債 証券	UNITED MEXICAN STATES	1,200,000	11,323.89	135,886,657	10,753.08	129,036,949	2.659	2031/05/24	4.16
カタール	国債 証券	STATE OF QATAR	900,000	12,631.21	113,680,905	12,190.35	109,713,175	4.400	2050/04/16	3.54
メキシコ	国債 証券	UNITED MEXICAN STATES	900,000	11,162.78	100,465,046	10,887.64	97,988,732	5.000	2051/04/27	3.16
ドミニカ共和国	国債 証券	DOMINICAN REPUBLIC	800,000	12,237.01	97,896,107	12,040.27	96,322,152	6.000	2033/02/22	3.10
トルコ	国債 証券	REPUBLIC OF TURKEY	800,000	10,670.08	85,360,602	11,889.65	95,117,236	6.125	2028/10/24	3.07
ペルー	国債 証券	REPUBLIC OF PERU	800,000	11,234.22	89,873,729	11,042.37	88,338,920	2.783	2031/01/23	2.85
中国	国債 証券	CHINA GOVT INTL BOND	700,000	12,252.25	85,765,735	12,006.17	84,043,156	1.250	2026/10/26	2.71
サウジアラビア	国債 証券	SAUDI INTERNATIONAL BOND	600,000	13,304.15	79,824,888	12,703.64	76,221,818	3.625	2028/03/04	2.46
パナマ	国債 証券	REPUBLIC OF PANAMA	800,000	9,487.90	75,903,205	9,482.87	75,862,997	4.500	2063/01/19	2.45
ブラジル	国債 証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	600,000	12,729.87	76,379,200	12,552.62	75,315,742	2.875	2025/06/06	2.43
アラブ 首長国 連邦	国債 証券	ABU DHABI GOVT INT'L	700,000	10,542.77	73,799,379	9,863.46	69,044,208	3.125	2049/09/30	2.23
アラブ 首長国 連邦	国債 証券	ABU DHABI GOVT INT'L	500,000	12,806.45	64,032,261	12,709.87	63,549,366	2.500	2025/04/16	2.05
チリ	国債 証券	REPUBLIC OF CHILE	600,000	10,585.43	63,512,608	10,453.71	62,722,247	2.550	2033/07/27	2.02
コロンビア	国債 証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	600,000	10,076.49	60,458,916	9,930.87	59,585,219	3.125	2031/04/15	1.92
パナマ	国債 証券	REPUBLIC OF PANAMA	600,000	10,616.13	63,696,796	9,880.71	59,284,255	2.252	2032/09/29	1.91
ドミニカ共和国	国債 証券	DOMINICAN REPUBLIC	600,000	9,551.15	57,306,893	9,809.58	58,857,492	5.875	2060/01/30	1.90
ブラジル	国債 証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	500,000	11,942.07	59,710,355	11,546.36	57,731,798	3.875	2030/06/12	1.86
オマーン	国債 証券	OMAN GOV INTERNTL BOND	400,000	12,601.72	50,406,891	13,345.90	53,383,617	6.000	2029/08/01	1.72
ペルー	国債 証券	REPUBLIC OF PERU	400,000	14,260.67	57,042,687	13,242.00	52,968,001	5.625	2050/11/18	1.71
ウルグアイ	国債 証券	REPUBLICA ORIENT URUGUAY	400,000	13,321.09	53,284,358	13,231.25	52,925,006	4.375	2031/01/23	1.71

インド ネシア	国債 証券	REPUBLIC OF INDONESIA	400,000	12,598.01	50,392,028	12,891.27	51,565,096	5.125	2045/01/15	1.66
ウルグ アイ	国債 証券	REPUBLICA ORIENT URUGUAY	400,000	13,263.37	53,053,460	12,793.87	51,175,489	4.975	2055/04/20	1.65
トルコ	国債 証券	REPUBLIC OF TURKEY	400,000	11,977.10	47,908,415	12,759.11	51,036,420	6.375	2025/10/14	1.64
南アフ リカ	国債 証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	400,000	12,912.11	51,648,432	12,436.51	49,746,045	5.875	2030/06/22	1.60
チリ	国債 証券	REPUBLIC OF CHILE	400,000	12,322.79	49,291,149	12,244.23	48,976,916	2.750	2027/01/31	1.58
南アフ リカ	国債 証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	400,000	12,218.49	48,873,940	11,901.33	47,605,328	4.850	2029/09/30	1.53

ロ 種類別投資比率

2022年12月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	94.53
合計	94.53

リ 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12月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド	1,193	677,624.39	808,405,903	588,000.00	701,484,000	6.39
日本	投資証券	ジャパンリアルエ ステイト	1,022	631,420.76	645,312,016	577,000.00	589,694,000	5.37
日本	投資証券	日本都市ファンド	5,161	109,426.15	564,748,365	104,700.00	540,356,700	4.92
日本	投資証券	野村不動産マス ターフ	3,308	167,109.69	552,798,841	163,000.00	539,204,000	4.91
日本	投資証券	日本プロロジス リート	1,724	342,525.23	590,513,491	308,500.00	531,854,000	4.85
日本	投資証券	G L P 投資法人	3,302	167,775.89	553,995,984	151,300.00	499,592,600	4.55
日本	投資証券	大和ハウスリート	1,542	318,674.10	491,395,460	293,400.00	452,422,800	4.12
日本	投資証券	オリックス不動産 投資	2,039	192,222.35	391,941,377	186,500.00	380,273,500	3.46
日本	投資証券	アドバンス・レジ デンス	1,023	356,359.50	364,555,766	339,000.00	346,797,000	3.16
日本	投資証券	ユナイテッドアー バン投資	2,289	147,975.54	338,716,001	150,600.00	344,723,400	3.14
日本	投資証券	日本プライムリアル ティ	700	400,218.36	280,152,852	370,500.00	259,350,000	2.36
日本	投資証券	ジャパン・ホテ ル・リート	3,302	70,270.41	232,032,878	77,500.00	255,905,000	2.33
日本	投資証券	産業ファンド	1,530	176,929.47	270,702,088	151,800.00	232,254,000	2.12
日本	投資証券	インヴィンシブル 投資法	4,508	43,725.81	197,115,929	51,000.00	229,908,000	2.09
日本	投資証券	積水ハウス・リー ト投資	3,073	83,142.00	255,495,371	74,600.00	229,245,800	2.09
日本	投資証券	A P I 投資法人	540	426,117.99	230,103,712	413,000.00	223,020,000	2.03

日本	投資証券	日本ロジスティクス F	690	326,581.89	225,341,506	313,500.00	216,315,000	1.97
日本	投資証券	日本アコモデーションF	353	669,094.33	236,190,298	603,000.00	212,859,000	1.94
日本	投資証券	ラサールロジポート投資	1,254	172,272.88	216,030,188	160,100.00	200,765,400	1.83
日本	投資証券	三井不ロジパーク	404	534,966.39	216,126,421	481,000.00	194,324,000	1.77
日本	投資証券	フロンティア不動産投資	379	528,696.29	200,375,893	512,000.00	194,048,000	1.77
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資	596	353,146.61	210,475,378	320,000.00	190,720,000	1.74
日本	投資証券	森ヒルズリート	1,205	154,961.12	186,728,150	157,400.00	189,667,000	1.73
日本	投資証券	イオンリート投資	1,134	155,622.28	176,475,662	154,500.00	175,203,000	1.60
日本	投資証券	大和証券リビング投	1,376	121,523.74	167,216,660	114,900.00	158,102,400	1.44
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法	959	166,525.05	159,697,524	163,900.00	157,180,100	1.43
日本	投資証券	ケネディクスレジデンシャル	752	218,828.06	164,558,699	205,600.00	154,611,200	1.41
日本	投資証券	三菱地所物流REIT	351	466,102.81	163,602,088	422,000.00	148,122,000	1.35
日本	投資証券	東急リアル・エステート	687	198,293.19	136,227,422	207,500.00	142,552,500	1.30
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル	477	332,025.79	158,376,302	296,600.00	141,478,200	1.29

□ 種類別投資比率

2022年12月30日現在

種類	投資比率 (%)
投資証券	98.75
合計	98.75

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12月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額単価 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	128,564	17,198.87	2,211,155,302	15,123.82	1,944,378,665	8.17
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	12,910	88,464.41	1,142,075,500	88,294.60	1,139,883,273	4.79
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	21,939	45,015.29	987,590,379	37,498.37	822,676,651	3.45
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	87,708	9,259.01	812,089,214	8,496.78	745,235,667	3.13
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	45,601	14,174.16	646,355,643	15,568.36	709,932,966	2.98
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	66,190	10,125.72	670,221,573	8,735.64	578,212,077	2.43
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	133,286	4,493.27	598,890,458	4,300.81	573,237,361	2.41
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	39,776	16,502.88	656,418,627	13,442.51	534,689,277	2.25

アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	19,520	27,477.08	536,352,649	21,583.66	421,312,945	1.77
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	20,661	20,993.16	433,739,690	19,268.04	398,096,974	1.67
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	47,128	10,095.75	475,792,576	7,940.77	374,232,514	1.57
オーストラ リア	投資証券	GOODMAN GROUP	236,100	1,723.61	406,944,230	1,555.83	367,331,675	1.54
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	18,533	27,246.57	504,960,608	19,773.63	366,464,629	1.54
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	56,111	6,327.10	355,019,844	6,045.81	339,236,557	1.42
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	16,150	23,242.43	375,365,246	20,932.10	338,053,382	1.42
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	17,270	20,988.19	362,466,106	19,218.94	331,911,111	1.39
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	81,180	4,969.59	403,431,101	3,984.98	323,500,757	1.36
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	29,170	11,337.31	330,709,190	10,414.30	303,785,014	1.28
香港	投資証券	LINK REIT	294,700	1,027.33	302,753,794	966.74	284,897,099	1.20
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	40,229	7,181.72	288,913,538	6,652.25	267,613,405	1.12
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	76,084	3,562.84	271,075,038	3,344.04	254,427,939	1.07
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	8,849	36,996.68	327,383,623	28,433.63	251,609,183	1.06
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	35,357	6,738.76	238,262,369	6,904.38	244,118,199	1.03
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	85,800	2,917.57	250,327,519	2,807.93	240,920,565	1.01
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	14,887	17,936.31	267,017,908	14,987.14	223,113,523	0.94
アメリカ	投資証券	UDR INC	42,269	6,213.74	262,648,782	5,163.36	218,249,937	0.92
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	99,100	2,465.95	244,375,719	2,097.99	207,910,511	0.87
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	167,300	1,539.34	257,532,161	1,238.40	207,184,320	0.87
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	23,766	9,651.31	229,373,085	8,667.96	206,002,832	0.87
オーストラ リア	投資証券	SCENTRE GROUP	734,000	255.17	187,293,679	260.65	191,316,145	0.80

□ 種類別投資比率

2022年12月30日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	97.08
合計	97.08

ゴールド・インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄

2022年12月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	投資信託 受益証券	SPDR Gold MiniShares Trust	603,960	4,607.1085	2,782,509,267	4,779.8540	2,886,840,621	70.21
アメリカ	投資信託 受益証券	iShares Gold Trust	249,190	4,396.2412	1,095,499,342	4,570.1880	1,138,845,147	27.70

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12月30日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	97.90
合計	97.90

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。

225マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

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。

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。

ゴールド・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12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0503 月2023年3月	買建	140	日本・円	2,700,769,000	2,648,100,000	1.24

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2.2.5 マザーファンド

2022年12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	NK225先物0503 月2023年3月	買建	158	日本・円	4,156,043,800	4,120,640,000	3.17

(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。

外国株式インデックス・マザーファンド

2022年12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	ICE-EU	FTSE 100 INDEX FUT MAR 23 2023年3月	買建	37	イギリス・ポンド	2,764,029.00	442,244,640	2,775,740.00	444,118,400	0.11
	ドイツ	EUROSTOXX	EUROSTOXX 50 MAR 23 2023年3月	買建	269	ユーロ	10,488,613.00	1,483,824,081	10,364,570.00	1,466,275,717	0.35
	アメリカ	シカゴ商品取引所	S&P 500 EMINI FUT MAR 23 2023年3月	買建	283	アメリカ・ドル	56,001,314.00	7,431,374,367	54,785,262.50	7,270,004,333	1.74
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURE MAR 23 2023年3月	買建	23	オーストラリア・ドル	4,086,703.50	366,046,032	4,002,575.00	358,510,642	0.09

(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12月30日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	買建	11,882,000.00	1,588,395,988	1,575,511,627	0.38
	ユーロ	買建	1,579,000.00	224,305,377	223,289,437	0.05
	イギリス・ポンド	買建	520,000.00	83,600,296	83,148,000	0.02
	カナダ・ドル	買建	808,000.00	79,847,368	79,037,752	0.02
	スイス・フラン	買建	490,000.00	70,541,380	70,420,742	0.02
	オーストラリア・ドル	買建	631,000.00	56,784,447	56,490,148	0.01
	スウェーデン・クローナ	買建	2,560,000.00	32,730,112	32,452,608	0.01
	香港・ドル	買建	1,850,000.00	31,736,750	31,466,095	0.01
	デンマーク・クローネ	買建	1,589,000.00	30,401,701	30,212,451	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。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2022年12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 M A R 2 3 2 0 2 3 年 3 月	買建	468	アメ リカ・ド ル	23,199,633.00	3,078,591,299	22,807,980.00	3,026,618,946	11.47

(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12月30日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	買建	925,293.03	124,000,000	122,677,107	0.46

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

2022年12月30日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	買建	230,000.00	30,745,020	30,498,368	0.98

(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12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	TREI T 先 物 0503 月 2023年 3月	買建	20	日本・円	38,280,400	37,500,000	0.34
-----------	----	-------	--	----	----	------	------------	------------	------

(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12月30日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	買建	437,437.14	58,600,000	57,998,131	0.24
	イギリス・ポンド	買建	40,909.10	6,600,000	6,540,546	0.03
	オーストラリア・ドル	買建	63,687.01	5,700,000	5,700,420	0.02
	ユーロ	買建	36,783.82	5,200,000	5,201,066	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。

ゴールド・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

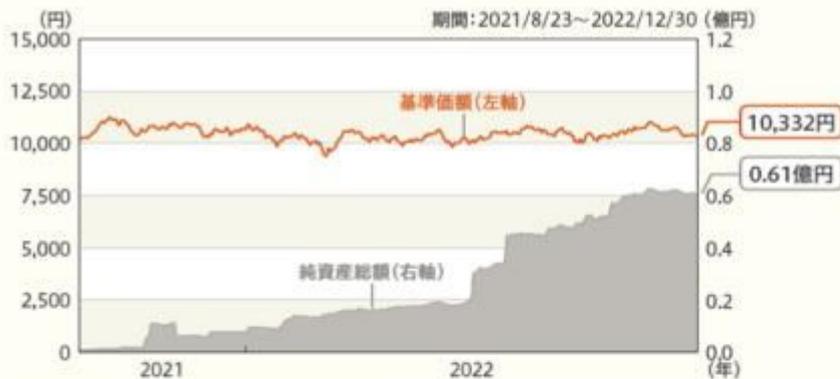
参考情報

基準日:2022年12月30日

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

基準価額・純資産の推移

■TOPIXインデックス

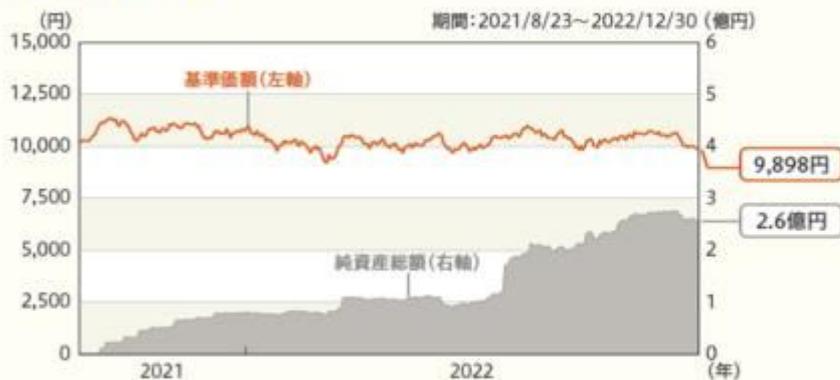


※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2022年11月	0円
2021年11月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

■225インデックス



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2022年11月	0円
2021年11月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

■先進国株インデックス

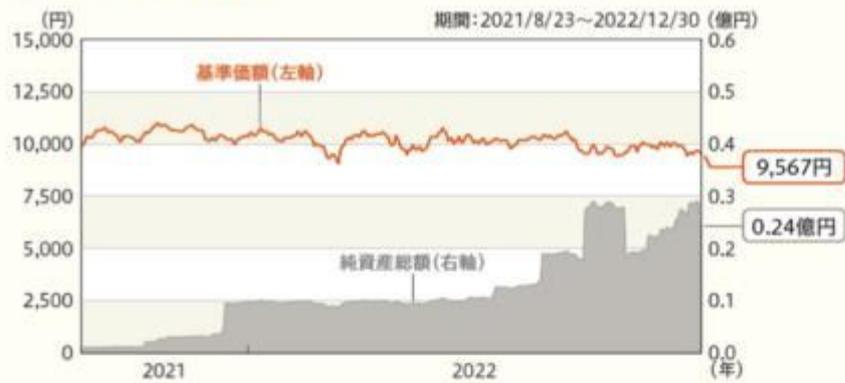


※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2022年11月	0円
2021年11月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

■新興国株インデックス



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2022年11月	0円
2021年11月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

■先進国債インデックス

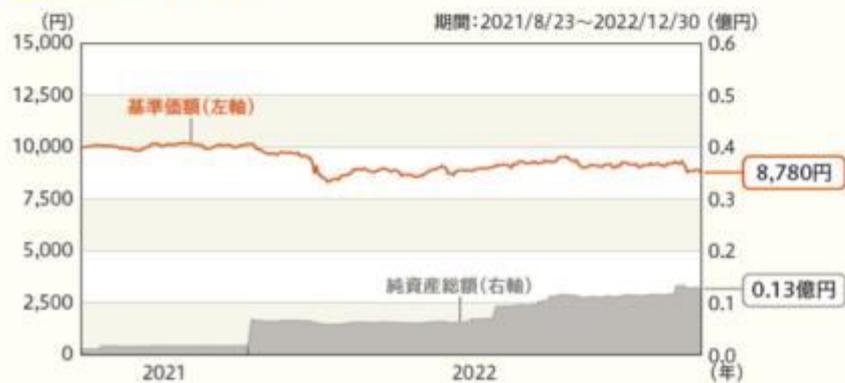


※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2022年11月	0円
2021年11月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

■新興国債インデックス



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2022年11月	0円
2021年11月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

■Jリートインデックス



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2022年11月	0円
2021年11月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

■Gリートインデックス

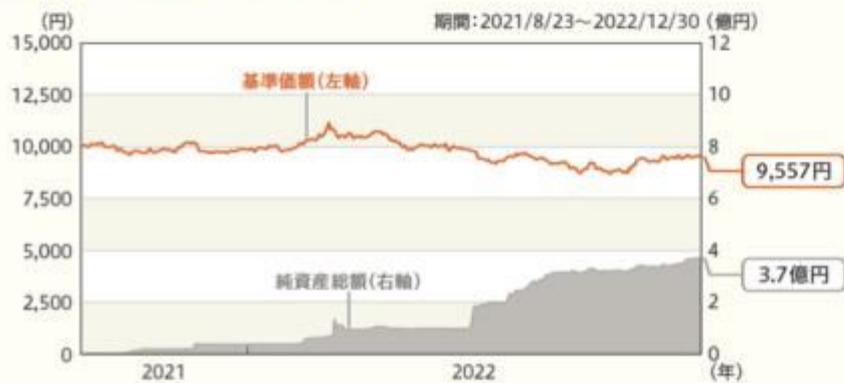


※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2022年11月	0円
2021年11月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

■ゴールドインデックスヘッジ有



※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11月	0円
2021年11月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

主要な資産の状況

■TOPIXインデックス

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.03
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	100.03

■国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

資産別構成

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

※株価指数先物取引の興建で1.24%

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	3.61
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2.57
日本	株式	三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	2.01
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.86
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.75
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.38
日本	株式	第一三共	医薬品	1.35
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1.32
日本	株式	任天堂	その他製品	1.27
日本	株式	日立製作所	電気機器	1.23

■225インデックス

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.03
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	225マザーファンド	100.03

■225マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	日本	96.82
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3.18
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の興建で3.17%

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	10.23
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	4.94
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	4.30
日本	株式	KDDI	情報・通信業	3.04
日本	株式	ダイキン工業	機械	2.57
日本	株式	ファナック	電気機器	2.52
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	2.15
日本	株式	信越化学工業	化学	2.06
日本	株式	テルモ	精密機器	1.90
日本	株式	京セラ	電気機器	1.66

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

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

■先進国株インデックス

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.04
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	100.04

■外国株式インデックス・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	アメリカ	66.23
	イギリス	4.34
	カナダ	3.66
	スイス	3.35
	フランス	3.26
	ドイツ	2.41
	その他	12.14
投資証券	アメリカ・その他	2.35
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.26
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て2.28%

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー/ハードウェアおよび機器	4.34
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	3.56
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	1.61
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	1.10
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	1.03
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1.03
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品/バイオテクノロジー/ヘルスケア	0.97
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	0.95
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	0.84
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	0.82

■新興国株インデックス

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.04
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	100.04

■エマージング株式インデックス・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	ケイマン諸島	16.51
	インド	12.89
	台湾	11.84
	韓国	10.08
	その他	25.60
投資証券	アメリカ	6.50
	その他	0.65
投資信託受益証券	香港	4.59
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		11.34
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て11.47%

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	5.01
香港	投資信託受益証券	CHINAAMC ETF SERIES - CH/ONY	-	4.59
ケイマン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	3.78
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	-	3.60
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	2.95
ケイマン諸島	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	小売	2.28
ケイマン諸島	株式	MEITUAN-CLASS B	小売	1.46
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	1.32
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI UAE ETF	-	1.21
ブラジル	株式	VALE SA	素材	0.91

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

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

■先進国債インデックス

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.02
合計(純資産総額)		100.00

■外国債券パッシブ・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	アメリカ	50.69
	フランス	8.53
	イタリア	7.52
	ドイツ	6.71
	スペイン	5.02
	イギリス	4.63
	中国	3.64
	その他	12.99
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.26
合計(純資産総額)		100.00

■新興国債インデックス

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	98.59
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.41
合計(純資産総額)		100.00

■米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	カタール	8.94
	アラブ首長国連邦	8.89
	サウジアラビア	8.88
	メキシコ	8.30
	チリ	6.30
	ブラジル	6.22
	オマーン	6.04
	その他	40.96
	現金・預金・その他の資産(負債控除後)	
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	100.02

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2026/05/15	1.25
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2026/03/31	1.14
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.875	2028/05/15	0.77
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.690	2026/08/12	0.66
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.125	2024/02/15	0.66
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.125	2031/02/15	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	2026/08/31	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.125	2024/03/31	0.57
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	3.020	2031/05/27	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.625	2027/12/31	0.55

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	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド	98.59

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
サウジアラビア	国債証券	SAUDI INTERNATIONAL BOND	2.250	2033/02/02	5.58
アラブ首長国連邦	国債証券	ABU DHABI GOVT INTL	1.875	2031/09/15	4.62
カタール	国債証券	STATE OF QATAR	3.750	2030/04/16	4.57
オマーン	国債証券	OMAN GOV INTERNTL BOND	6.250	2031/01/25	4.32
メキシコ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2.659	2031/05/24	4.16
カタール	国債証券	STATE OF QATAR	4.400	2050/04/16	3.54
メキシコ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	5.000	2051/04/27	3.16
ドミニカ共和国	国債証券	DOMINICAN REPUBLIC	6.000	2033/02/22	3.10
トルコ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	6.125	2028/10/24	3.07
ペルー	国債証券	REPUBLIC OF PERU	2.783	2031/01/23	2.85

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

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

■Jリートインデックス

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.03
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	100.03

■Jリート・インデックス・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
投資証券	日本	98.75
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.25
合計(純資産総額)		100.00

※Jリート指数先物取引の買建て0.34%

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド	6.39
日本	投資証券	シャペンリアルエステイト	5.37
日本	投資証券	日本都市ファンド	4.92
日本	投資証券	野村不動産マスターF	4.91
日本	投資証券	日本プロロジスリート	4.85
日本	投資証券	GLP投資法人	4.55
日本	投資証券	大和ハウスリート	4.12
日本	投資証券	オリックス不動産投資	3.46
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス	3.16
日本	投資証券	ユナイテッドアーバン投資	3.14

■Gリートインデックス

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.04
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	100.04

■外国リート・インデックス・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
投資証券	アメリカ	74.83
	オーストラリア	6.44
	イギリス	4.58
	シンガポール	3.60
	カナダ	1.81
	フランス	1.72
	香港	1.44
	その他	2.66
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.92
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	8.17
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	4.79
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	3.45
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	3.13
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	2.98
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	2.43
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	2.41
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	2.25
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	1.77
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1.67

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

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

■ゴールドインデックスヘッジ有

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	97.69
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.31
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	ゴールド・インデックス・マザーファンド	97.69

■ゴールド・インデックス・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	97.90
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.10
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
アメリカ	投資信託受益証券	SPDR GOLD MINISHARES TRUST	70.21
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES GOLD TRUST	27.70

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

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

年間収益率の推移(暦年ベース)

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



■225インデックス(ベンチマーク:日経平均株価(日経225))



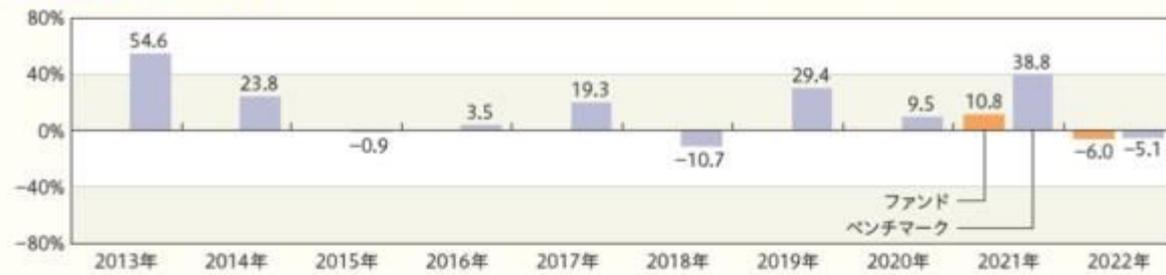
※ファンドの収益率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しています。分配実績がない場合は、基準価額の騰落率です。

※ファンドが設定された年のファンドの収益率は、設定日から年末までの騰落率です。

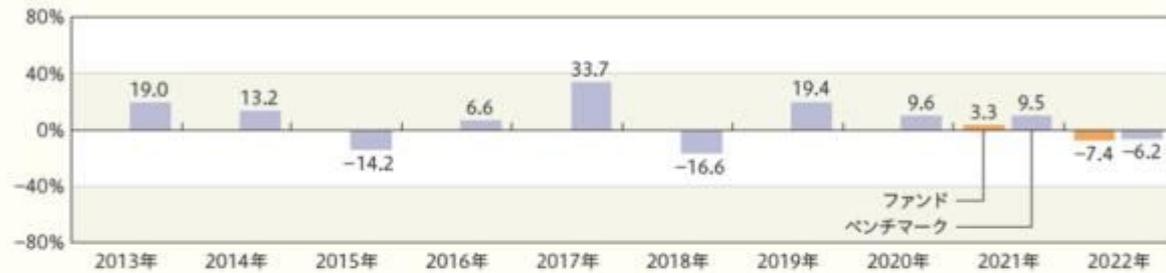
※2022年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。

※ベンチマークの情報は参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

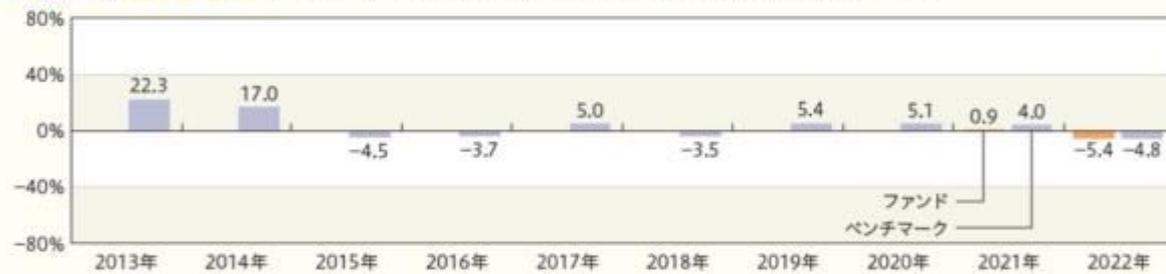
■先進国株インデックス(ベンチマーク:MSCIコクサイインデックス(配当込み、円ベース))



■新興国株インデックス(ベンチマーク:MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース))



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



■新興国債インデックス(ベンチマーク: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))



※ファンドの収益率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しています。分配実績がない場合は、基準価額の騰落率です。

※ファンドが設定された年のファンドの収益率は、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。

※ベンチマークの情報は参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

■Jリートインデックス(ベンチマーク:東証REIT指数(配当込み))



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



■ゴールドインデックスヘッジ有(ベンチマーク:LBMA金価格(円ヘッジ換算ベース))



※ファンドの収益率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しています。分配実績がない場合は、基準価額の騰落率です。
 ※ファンドが設定された年のファンドの収益率は、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。
 ※ベンチマークの情報は参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

イ 申込方法

(イ) ファンドの取得申込者は、お申込みを取り扱う販売会社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、取得申込みの受付を中止させていただく場合、既に受け付けた取得申込みを取り消させていただく場合があります。

(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、各ファンドにつき、取得申込日が以下の申込不可日に当たる場合には、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。）。

ファンド名	申込不可日
先進国株インデックス	・ ニューヨークの取引所の休業日 ・ ロンドンの取引所の休業日
新興国株インデックス	・ ニューヨークの取引所の休業日 ・ ロンドンの取引所の休業日 ・ 香港の取引所の休業日
先進国債インデックス	・ ニューヨークの銀行の休業日 ・ ロンドンの銀行の休業日
新興国債インデックス	・ ニューヨークの取引所の休業日 ・ ロンドンの取引所の休業日 ・ ニューヨークの銀行の休業日 ・ ロンドンの銀行の休業日
Gリートインデックス	・ ニューヨークの取引所の休業日 ・ オーストラリアの取引所の休業日 ・ ニューヨークの銀行の休業日
ゴールドインデックスヘッジ有	・ 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

「TOPIXインデックス」、「225インデックス」、「Jリートインデックス」は、申込不可日はありません。

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、お申込み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D Sアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	https://www.smd-am.co.jp

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

へ 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經由して、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、以下の申込不可日に当たる場合には、解約請求の受付は行いません。

ファンド名	申込不可日
先進国株インデックス	<ul style="list-style-type: none"> ・ニューヨークの取引所の休業日 ・ロンドンの取引所の休業日
新興国株インデックス	<ul style="list-style-type: none"> ・ニューヨークの取引所の休業日 ・ロンドンの取引所の休業日 ・香港の取引所の休業日
先進国債インデックス	<ul style="list-style-type: none"> ・ニューヨークの銀行の休業日 ・ロンドンの銀行の休業日
新興国債インデックス	<ul style="list-style-type: none"> ・ニューヨークの取引所の休業日 ・ロンドンの取引所の休業日 ・ニューヨークの銀行の休業日 ・ロンドンの銀行の休業日
Gリートインデックス	<ul style="list-style-type: none"> ・ニューヨークの取引所の休業日 ・オーストラリアの取引所の休業日 ・ニューヨークの銀行の休業日
ゴールドインデックスヘッジ有	<ul style="list-style-type: none"> ・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

「TOPIXインデックス」、「225インデックス」、「Jリートインデックス」は、申込不可日はありません。

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

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

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して6営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

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。）。投資対象とする親投資信託受益証券は、当該親投資信託受益証券の基準価額で評価します。なお、外貨建資産の円換算については、原則として日本における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算するものとします。また、予約為替の評価は、原則として日本における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

<主要投資対象の評価方法>

「各マザーファンド（ゴールド・インデックス・マザーファンドを除く）」

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。

「ゴールド・インデックス・マザーファンド」

主要投資対象	有価証券等の評価方法
投資信託証券	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。

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

ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、以下の通り掲載されます。

ファンド名	掲載名
TOPIXインデックス	SMDTPイ
225インデックス	SMD225イ
先進国株インデックス	SMD先株イ
新興国株インデックス	SMD興株イ
先進国債インデックス	SMD先債イ
新興国債インデックス	SMD興債イ
Jリートインデックス	SMDJリイ
Gリートインデックス	SMDGリイ

ゴールドインデックスヘッジ有	SMD金IH
----------------	--------

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

(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】

2021年8月23日から下記「(5) その他 イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

(4) 【計算期間】

毎年12月1日から翌年11月30日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(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、各ファンドの残存口数が30億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。
- c. 書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b～dまでの取扱いは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b～dまでの取扱いを行うことが困難な場合も同様とします。

(ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令

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

(八) 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。

(二) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

ロ 収益分配金、償還金の支払い

(イ) 収益分配金

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

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

(ロ) 償還金

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

八 信託約款の変更等

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

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

る受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

- (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、これを行行使うことができます。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、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依り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、持分に依り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使することができます。

ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期(2021年12月1日から2022年11月30日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (2021年11月30日現在)	第2期 (2022年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	84
コール・ローン	-	519
親投資信託受益証券	6,051,301	61,811,019
流動資産合計	6,051,301	61,811,622
資産合計	6,051,301	61,811,622
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	268	4,635
未払委託者報酬	4,663	77,353
その他未払費用	21	1,065
流動負債合計	4,952	83,053
負債合計	4,952	83,053
純資産の部		
元本等		
元本	5,873,388	56,998,952
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	172,961	4,729,617
(分配準備積立金)	13,736	2,721,892
元本等合計	6,046,349	61,728,569
純資産合計	6,046,349	61,728,569
負債純資産合計	6,051,301	61,811,622

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期		第2期	
	自	2021年 8月23日 至 2021年11月30日	自	2021年12月 1日 至 2022年11月30日
営業収益				
有価証券売買等損益		104,008		3,088,520
営業収益合計		104,008		3,088,520
営業費用				
受託者報酬		268		6,016
委託者報酬		4,663		101,066
その他費用		21		1,352
営業費用合計		4,952		108,434
営業利益又は営業損失 ()		108,960		2,980,086
経常利益又は経常損失 ()		108,960		2,980,086
当期純利益又は当期純損失 ()		108,960		2,980,086
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 ()		117,673		36,828
期首剰余金又は期首欠損金 ()		-		172,961
剰余金増加額又は欠損金減少額		744,703		1,642,270
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		744,703		1,642,270
剰余金減少額又は欠損金増加額		345,109		28,872
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		345,109		28,872
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ()		172,961		4,729,617

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第2期	
	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第1期	第2期
	(2021年11月30日現在)	(2022年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	5,873,388口	56,998,952口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0294円 (1万口当たりの純資産額10,294円)	1口当たり純資産額 1.0830円 (1万口当たりの純資産額10,830円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第1期	第2期
	自 2021年8月23日 至 2021年11月30日	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（13,736円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（159,225円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は172,961円（1万口当たり294.48円）であります。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（749,005円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（1,959,470円）、収益調整金（2,007,725円）、および分配準備積立金（13,417円）より、分配対象収益は4,729,617円（1万口当たり829.77円）であります。分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	第2期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。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	第2期 (2022年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自2021年8月23日 至 2021年11月30日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	219,001円
合計	219,001円

第2期(自2021年12月1日 至 2022年11月30日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	3,051,263円
合計	3,051,263円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第2期 自2021年12月1日 至2022年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項目	第1期 (2021年11月30日現在)	第2期 (2022年11月30日現在)
期首元本額	1,000,000円	5,873,388円
期中追加設定元本額	10,131,313円	52,125,564円
期中一部解約元本額	5,257,925円	1,000,000円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受 益証券	国内株式インデックス・マザーファン ド(B号)	18,140,230	61,811,019	
	親投資信託受益証券 小計		61,811,019	
合 計			61,811,019	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【三井住友D S ・日経225インデックス・ファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 (2021年11月30日現在)	第2期 (2022年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	177
コール・ローン	-	1,094
親投資信託受益証券	69,557,660	272,785,410
流動資産合計	69,557,660	272,786,681
資産合計	69,557,660	272,786,681
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	2,295	20,288
未払委託者報酬	38,037	335,423
その他未払費用	524	5,003
流動負債合計	40,856	360,714
負債合計	40,856	360,714
純資産の部		
元本等		
元本	67,088,151	257,073,979
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2,428,653	15,351,988
(分配準備積立金)	173,689	4,052,087
元本等合計	69,516,804	272,425,967
純資産合計	69,516,804	272,425,967
負債純資産合計	69,557,660	272,786,681

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期		第2期	
	自	2021年 8月23日 至 2021年11月30日	自	2021年12月 1日 至 2022年11月30日
営業収益				
有価証券売買等損益		3,544,012		7,944,616
営業収益合計		3,544,012		7,944,616
営業費用				
支払利息		-		8
受託者報酬		2,295		30,082
委託者報酬		38,037		497,842
その他費用		524		7,367
営業費用合計		40,856		535,299
営業利益又は営業損失()		3,584,868		7,409,317
経常利益又は経常損失()		3,584,868		7,409,317
当期純利益又は当期純損失()		3,584,868		7,409,317
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		30,095		537,771
期首剰余金又は期首欠損金()		-		2,428,653
剰余金増加額又は欠損金減少額		6,085,896		7,001,684
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		6,085,896		7,001,684
剰余金減少額又は欠損金増加額		102,470		949,895
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		102,470		949,895
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		2,428,653		15,351,988

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第2期	
	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第1期	第2期
	(2021年11月30日現在)	(2022年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	67,088,151口	257,073,979口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0362円 (1万口当たりの純資産額10,362円)	1口当たり純資産額 1.0597円 (1万口当たりの純資産額10,597円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第1期	第2期
	自 2021年8月23日 至 2021年11月30日	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（173,689円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（2,254,964円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は2,428,653円（1万口当たり362.01円）であります。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（2,875,577円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（1,038,748円）、収益調整金（11,299,901円）、および分配準備積立金（137,762円）より、分配対象収益は15,351,988円（1万口当たり597.18円）であります。分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	第2期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。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	第2期 (2022年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自2021年8月23日 至 2021年11月30日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	3,520,643円
合計	3,520,643円

第2期(自2021年12月1日 至 2022年11月30日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	7,454,335円
合計	7,454,335円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第2期 自2021年12月1日 至2022年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項目	第1期 (2021年11月30日現在)	第2期 (2022年11月30日現在)
期首元本額	1,000,000円	67,088,151円
期中追加設定元本額	67,267,713円	221,907,962円
期中一部解約元本額	1,179,562円	31,922,134円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受 益証券	2 2 5 マザーファンド	73,400,444	272,785,410	
	親投資信託受益証券 小計		272,785,410	
合 計			272,785,410	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【三井住友D S ・先進国株式インデックス・ファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位 : 円)

	第1期 (2021年11月30日現在)	第2期 (2022年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	189
コール・ローン	-	1,163
親投資信託受益証券	74,627,082	309,573,888
流動資産合計	74,627,082	309,575,240
資産合計	74,627,082	309,575,240
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	1,930	25,267
未払委託者報酬	39,784	518,715
その他未払費用	539	7,510
流動負債合計	42,253	551,492
負債合計	42,253	551,492
純資産の部		
元本等		
元本	70,018,428	278,407,177
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	4,566,401	30,616,571
(分配準備積立金)	1,578,993	9,686,410
元本等合計	74,584,829	309,023,748
純資産合計	74,584,829	309,023,748
負債純資産合計	74,627,082	309,575,240

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期		第2期	
	自	2021年 8月23日 至 2021年11月30日	自	2021年12月 1日 至 2022年11月30日
営業収益				
有価証券売買等損益		1,764,416		11,800,039
営業収益合計		1,764,416		11,800,039
営業費用				
支払利息		-		37
受託者報酬		1,930		37,289
委託者報酬		39,784		766,067
その他費用		539		11,036
営業費用合計		42,253		814,429
営業利益又は営業損失()		1,722,163		10,985,610
経常利益又は経常損失()		1,722,163		10,985,610
当期純利益又は当期純損失()		1,722,163		10,985,610
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		143,170		2,401,628
期首剰余金又は期首欠損金()		-		4,566,401
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,061,837		21,691,934
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,061,837		21,691,934
剰余金減少額又は欠損金増加額		74,429		4,225,746
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		74,429		4,225,746
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()		4,566,401		30,616,571

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第2期	
	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第1期	第2期
	(2021年11月30日現在)	(2022年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	70,018,428口	278,407,177口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0652円 (1万口当たりの純資産額10,652円)	1口当たり純資産額 1.1100円 (1万口当たりの純資産額11,100円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第1期	第2期
	自 2021年8月23日 至 2021年11月30日	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（139,167円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（1,439,826円）、収益調整金（2,987,408円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は4,566,401円（1万口当たり652.17円）であります、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（2,868,645円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（5,715,337円）、収益調整金（20,930,161円）、および分配準備積立金（1,102,428円）より、分配対象収益は30,616,571円（1万口当たり1,099.70円）であります、分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	第2期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。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	第2期 (2022年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自2021年8月23日 至 2021年11月30日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,625,367円
合計	1,625,367円

第2期(自2021年12月1日 至 2022年11月30日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	9,583,936円
合計	9,583,936円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第2期 自2021年12月1日 至2022年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項目	第1期 (2021年11月30日現在)	第2期 (2022年11月30日現在)
期首元本額	1,000,000円	70,018,428円
期中追加設定元本額	71,990,426円	270,552,214円
期中一部解約元本額	2,971,998円	62,163,465円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	50,536,075	309,573,888	
	親投資信託受益証券 小計		309,573,888	
合計			309,573,888	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【三井住友D S ・新興国株式インデックス・ファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位 : 円)

	第1期 (2021年11月30日現在)	第2期 (2022年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	80
コール・ローン	-	494
親投資信託受益証券	3,026,951	22,536,778
流動資産合計	3,026,951	22,537,352
資産合計	3,026,951	22,537,352
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	93	1,839
未払委託者報酬	2,355	38,694
その他未払費用	-	575
流動負債合計	2,448	41,108
負債合計	2,448	41,108
純資産の部		
元本等		
元本	2,960,151	22,559,233
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	64,352	62,989
(分配準備積立金)	4,096	273,906
元本等合計	3,024,503	22,496,244
純資産合計	3,024,503	22,496,244
負債純資産合計	3,026,951	22,537,352

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期		第2期	
	自	2021年 8月23日 至 2021年11月30日	自	2021年12月 1日 至 2022年11月30日
営業収益				
有価証券売買等損益		67,098		502,275
営業収益合計		67,098		502,275
営業費用				
受託者報酬		93		2,814
委託者報酬		2,355		59,220
その他費用		-		861
営業費用合計		2,448		62,895
営業利益又は営業損失 ()		69,546		565,170
経常利益又は経常損失 ()		69,546		565,170
当期純利益又は当期純損失 ()		69,546		565,170
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 ()		-		516,037
期首剰余金又は期首欠損金 ()		-		64,352
剰余金増加額又は欠損金減少額		133,898		-
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		133,898		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		78,208
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		9,647
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		68,561
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ()		64,352		62,989

（ 3 ）【注記表】

（重要な会計方針の注記）

項 目	第2期	
	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項 目	第1期	第2期
	(2021年11月30日現在)	(2022年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,960,151口	22,559,233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 62,989円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0217円 (1万口当たりの純資産額10,217円)	1口当たり純資産額 0.9972円 (1万口当たりの純資産額9,972円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項 目	第1期	第2期
	自 2021年8月23日 至 2021年11月30日	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（4,096円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（60,256円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は64,352円（1万口当たり217.39円）であります。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（271,266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（95,484円）、および分配準備積立金（2,640円）より、分配対象収益は369,390円（1万口当たり163.74円）であります。分配を行っておりません。</p>

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項 目	第2期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。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	第2期 (2022年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自 2021年8月23日 至 2021年11月30日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	67,098円
合計	67,098円

第2期(自 2021年12月1日 至 2022年11月30日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	11,693円
合計	11,693円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第2期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項目	第1期 (2021年11月30日現在)	第2期 (2022年11月30日現在)
期首元本額	1,000,000円	2,960,151円
期中追加設定元本額	1,960,151円	29,976,495円
期中一部解約元本額	-円	10,377,413円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受 益証券	エマージング株式インデックス・マ ザーファンド	13,672,741	22,536,778	
	親投資信託受益証券 小計		22,536,778	
合 計			22,536,778	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【三井住友D S ・先進国債インデックス・ファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位 : 円)

	第1期 (2021年11月30日現在)	第2期 (2022年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	89
コール・ローン	-	549
親投資信託受益証券	6,791,702	80,186,585
流動資産合計	6,791,702	80,187,223
資産合計	6,791,702	80,187,223
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	339	3,703
未払委託者報酬	4,253	46,809
その他未払費用	51	851
流動負債合計	4,643	51,363
負債合計	4,643	51,363
純資産の部		
元本等		
元本	6,762,046	79,842,763
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	25,013	293,097
(分配準備積立金)	28,398	472,369
元本等合計	6,787,059	80,135,860
純資産合計	6,787,059	80,135,860
負債純資産合計	6,791,702	80,187,223

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期		第2期	
	自	2021年 8月23日 至 2021年11月30日	自	2021年12月 1日 至 2022年11月30日
営業収益				
有価証券売買等損益		30,456		1,387,274
営業収益合計		30,456		1,387,274
営業費用				
受託者報酬		339		4,891
委託者報酬		4,253		61,901
その他費用		51		1,094
営業費用合計		4,643		67,886
営業利益又は営業損失 ()		25,813		1,455,160
経常利益又は経常損失 ()		25,813		1,455,160
当期純利益又は当期純損失 ()		25,813		1,455,160
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 ()		-		263,394
期首剰余金又は期首欠損金 ()		-		25,013
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		1,567,191
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		1,567,191
剰余金減少額又は欠損金増加額		800		107,341
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		107,341
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		800		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ()		25,013		293,097

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第2期	
	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第1期	第2期
	(2021年11月30日現在)	(2022年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	6,762,046口	79,842,763口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0037円 (1万口当たりの純資産額10,037円)	1口当たり純資産額 1.0037円 (1万口当たりの純資産額10,037円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第1期	第2期
	自 2021年8月23日 至 2021年11月30日	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（28,398円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（3,046円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は31,444円（1万口当たり46.50円）であります。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（460,737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（450,582円）、および分配準備積立金（11,632円）より、分配対象収益は922,951円（1万口当たり115.60円）であります。分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	第2期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。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	第2期 (2022年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自2021年8月23日 至2021年11月30日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	30,456円
合計	30,456円

第2期(自2021年12月1日 至2022年11月30日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,121,627円
合計	1,121,627円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第2期 自2021年12月1日 至2022年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項目	第1期 (2021年11月30日現在)	第2期 (2022年11月30日現在)
期首元本額	1,000,000円	6,762,046円
期中追加設定元本額	5,762,046円	86,535,230円
期中一部解約元本額	-円	13,454,513円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受 益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	40,133,426	80,186,585	
	親投資信託受益証券 小計		80,186,585	
合 計			80,186,585	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【三井住友D S ・新興国債インデックス・ファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位 : 円)

	第1期 (2021年11月30日現在)	第2期 (2022年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	557	29,399
コール・ローン	16,443	181,396
親投資信託受益証券	1,592,763	11,381,577
流動資産合計	1,609,763	11,592,372
資産合計	1,609,763	11,592,372
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	86	1,024
未払委託者報酬	1,824	21,590
その他未払費用	-	408
流動負債合計	1,910	23,022
負債合計	1,910	23,022
純資産の部		
元本等		
元本	1,621,093	12,592,578
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	13,240	1,023,228
(分配準備積立金)	15,495	302,215
元本等合計	1,607,853	11,569,350
純資産合計	1,607,853	11,569,350
負債純資産合計	1,609,763	11,592,372

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期		第2期	
	自	2021年 8月23日 至 2021年11月30日	自	2021年12月 1日 至 2022年11月30日
営業収益				
有価証券売買等損益		16,237		507,186
営業収益合計		16,237		507,186
営業費用				
受託者報酬		86		1,578
委託者報酬		1,824		33,501
その他費用		-		408
営業費用合計		1,910		35,487
営業利益又は営業損失()		18,147		542,673
経常利益又は経常損失()		18,147		542,673
当期純利益又は当期純損失()		18,147		542,673
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()		-		286
期首剰余金又は期首欠損金()		-		13,240
剰余金増加額又は欠損金減少額		4,907		-
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		4,907		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		467,601
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		62
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		467,539
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		13,240		1,023,228

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第2期	
	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	第1期	第2期
	(2021年11月30日現在)	(2022年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,621,093口	12,592,578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 13,240円	元本の欠損 1,023,228円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9918円 (1万口当たりの純資産額9,918円)	1口当たり純資産額 0.9187円 (1万口当たりの純資産額9,187円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期	第2期
	自 2021年8月23日 至 2021年11月30日	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(15,495円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(2,168円)、および分配準備積立金(0円)より、分配対象収益は17,663円(1万口当たり108.96円)であります。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(286,739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(156,603円)、および分配準備積立金(15,476円)より、分配対象収益は458,818円(1万口当たり364.36円)であります。分配を行っておりません。</p>

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項 目	第2期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。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	第2期 (2022年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自 2021年8月23日 至 2021年11月30日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	16,237円
合計	16,237円

第2期(自 2021年12月1日 至 2022年11月30日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	507,186円
合計	507,186円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第2期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項目	第1期 (2021年11月30日現在)	第2期 (2022年11月30日現在)
期首元本額	1,000,000円	1,621,093円
期中追加設定元本額	621,093円	10,979,714円
期中一部解約元本額	-円	8,229円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	米ドル建て新興国債インデックス・マ ザーファンド	12,227,737	11,381,577	
	親投資信託受益証券 小計		11,381,577	
合計			11,381,577	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【三井住友D S ・国内リートインデックス・ファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位 : 円)

	第1期 (2021年11月30日現在)	第2期 (2022年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	91
コール・ローン	-	565
親投資信託受益証券	2,143,958	118,143,132
流動資産合計	2,143,958	118,143,788
資産合計	2,143,958	118,143,788
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	98	4,927
未払委託者報酬	1,577	81,852
その他未払費用	-	1,145
流動負債合計	1,675	87,924
負債合計	1,675	87,924
純資産の部		
元本等		
元本	2,251,882	122,970,950
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	109,599	4,915,086
(分配準備積立金)	14,855	995,182
元本等合計	2,142,283	118,055,864
純資産合計	2,142,283	118,055,864
負債純資産合計	2,143,958	118,143,788

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期		第2期	
	自	2021年 8月23日 至 2021年11月30日	自	2021年12月 1日 至 2022年11月30日
営業収益				
有価証券売買等損益		104,093		469,229
営業収益合計		104,093		469,229
営業費用				
受託者報酬		98		5,635
委託者報酬		1,577		94,421
その他費用		-		1,206
営業費用合計		1,675		101,262
営業利益又は営業損失 ()		105,768		367,967
経常利益又は経常損失 ()		105,768		367,967
当期純利益又は当期純損失 ()		105,768		367,967
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 ()		575		535,928
期首剰余金又は期首欠損金 ()		-		109,599
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		430,256
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		430,256
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		3,256		6,139,638
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		471		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,785		6,139,638
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ()		109,599		4,915,086

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第2期	
	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第1期	第2期
	(2021年11月30日現在)	(2022年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,251,882口	122,970,950口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 109,599円	元本の欠損 4,915,086円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9513円 (1万口当たりの純資産額9,513円)	1口当たり純資産額 0.9600円 (1万口当たりの純資産額9,600円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第1期	第2期
	自 2021年8月23日 至 2021年11月30日	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（14,855円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（1,305円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は16,160円（1万口当たり71.76円）であります。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（991,788円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（1,176,269円）、および分配準備積立金（3,394円）より、分配対象収益は2,171,451円（1万口当たり176.58円）であります。分配を行っておりません。</p>

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項 目	第2期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。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	第2期 (2022年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自2021年8月23日 至 2021年11月30日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	104,511円
合計	104,511円

第2期(自2021年12月1日 至 2022年11月30日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	986,482円
合計	986,482円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第2期 自2021年12月1日 至2022年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項目	第1期 (2021年11月30日現在)	第2期 (2022年11月30日現在)
期首元本額	1,000,000円	2,251,882円
期中追加設定元本額	1,350,609円	132,574,732円
期中一部解約元本額	98,727円	11,855,664円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受 益証券	Jリート・インデックス・マザーファ ンド	43,763,199	118,143,132	
	親投資信託受益証券 小計		118,143,132	
合 計			118,143,132	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【三井住友D S ・先進国リートインデックス・ファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位 : 円)

	第1期 (2021年11月30日現在)	第2期 (2022年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	93
コール・ローン	-	571
親投資信託受益証券	2,307,225	87,051,905
流動資産合計	2,307,225	87,052,569
資産合計	2,307,225	87,052,569
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	96	5,407
未払委託者報酬	2,375	111,767
その他未払費用	-	1,550
流動負債合計	2,471	118,724
負債合計	2,471	118,724
純資産の部		
元本等		
元本	2,141,454	82,034,605
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	163,300	4,899,240
(分配準備積立金)	140,653	988,236
元本等合計	2,304,754	86,933,845
純資産合計	2,304,754	86,933,845
負債純資産合計	2,307,225	87,052,569

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期		第2期	
	自	2021年 8月23日 至 2021年11月30日	自	2021年12月 1日 至 2022年11月30日
営業収益				
有価証券売買等損益		143,124		3,749,709
営業収益合計		143,124		3,749,709
営業費用				
受託者報酬		96		6,385
委託者報酬		2,375		132,753
その他費用		-		1,759
営業費用合計		2,471		140,897
営業利益又は営業損失 ()		140,653		3,890,606
経常利益又は経常損失 ()		140,653		3,890,606
当期純利益又は当期純損失 ()		140,653		3,890,606
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 ()		-		226,848
期首剰余金又は期首欠損金 ()		-		163,300
剰余金増加額又は欠損金減少額		22,647		9,272,153
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		22,647		9,272,153
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		872,455
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		872,455
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ()		163,300		4,899,240

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第2期
	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第1期	第2期
	(2021年11月30日現在)	(2022年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,141,454口	82,034,605口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0763円 (1万口当たりの純資産額10,763円)	1口当たり純資産額 1.0597円 (1万口当たりの純資産額10,597円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第1期	第2期
	自 2021年8月23日 至 2021年11月30日	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（14,546円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（126,107円）、収益調整金（22,647円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は163,300円（1万口当たり762.57円）であります。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（943,319円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（5,564,859円）、および分配準備積立金（44,917円）より、分配対象収益は6,553,095円（1万口当たり798.82円）であります。分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	第2期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。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	第2期 (2022年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自2021年8月23日 至 2021年11月30日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	143,124円
合計	143,124円

第2期(自2021年12月1日 至 2022年11月30日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	3,516,688円
合計	3,516,688円

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第2期 自2021年12月1日 至2022年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項目	第1期 (2021年11月30日現在)	第2期 (2022年11月30日現在)
期首元本額	1,000,000円	2,141,454円
期中追加設定元本額	1,141,454円	90,161,002円
期中一部解約元本額	-円	10,267,851円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受 益証券	外国リート・インデックス・マザー ファンド	31,002,495	87,051,905	
	親投資信託受益証券 小計		87,051,905	
合 計			87,051,905	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【三井住友D S ・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)】

(1) 【貸借対照表】

(単位 : 円)

	第1期 (2021年11月30日現在)	第2期 (2022年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,958	14,969
コール・ローン	57,733	92,363
親投資信託受益証券	37,285,529	334,057,286
派生商品評価勘定	217,702	1,316,791
未収入金	15,187	1,069,582
流動資産合計	37,578,109	336,550,991
資産合計	37,578,109	336,550,991
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	572,472
未払受託者報酬	829	27,736
未払委託者報酬	14,041	458,109
その他未払費用	210	10,342
流動負債合計	15,080	1,068,659
負債合計	15,080	1,068,659
純資産の部		
元本等		
元本	38,535,757	361,645,871
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	972,728	26,163,539
(分配準備積立金)	-	-
元本等合計	37,563,029	335,482,332
純資産合計	37,563,029	335,482,332
負債純資産合計	37,578,109	336,550,991

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	2021年 8月23日	自	2021年12月 1日
	至	2021年11月30日	至	2022年11月30日
営業収益				
有価証券売買等損益		556,279		12,605,879
為替差損益		355,937		28,689,850
営業収益合計		912,216		16,083,971
営業費用				
受託者報酬		829		35,110
委託者報酬		14,041		580,576
その他費用		7,910		16,282
営業費用合計		22,780		631,968
営業利益又は営業損失（ ）		934,996		16,715,939
経常利益又は経常損失（ ）		934,996		16,715,939
当期純利益又は当期純損失（ ）		934,996		16,715,939
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（ ）		-		229,995
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		972,728
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		37,732		8,704,867
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		1,338,189
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		37,732		7,366,678
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		972,728		26,163,539

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第2期	
	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
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>	

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第1期	第2期
	(2021年11月30日現在)	(2022年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	38,535,757口	361,645,871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 972,728円	元本の欠損 26,163,539円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9748円 (1万口当たりの純資産額9,748円)	1口当たり純資産額 0.9277円 (1万口当たりの純資産額9,277円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第1期	第2期
	自 2021年8月23日 至 2021年11月30日	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日

分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0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(0円)、および分配準備積立金(0円)より、分配対象収益は0円(1万口当たり0.00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(0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(0円)、および分配準備積立金(0円)より、分配対象収益は0円(1万口当たり0.00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2期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 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2期 (2022年11月30日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第1期（自 2021年8月23日 至 2021年11月30日）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	572,946円

合計	572,946円
----	----------

第2期(自 2021年12月1日 至 2022年11月30日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	7,924,408円
合計	7,924,408円

(デリバティブ取引に関する注記)

第1期(2021年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	40,145,441	-	39,927,739	217,702
	小計	40,145,441	-	39,927,739	217,702
合 計		40,145,441	-	39,927,739	217,702

第2期(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	327,357,536	-	326,040,745	1,316,791
	小計	327,357,536	-	326,040,745	1,316,791
合 計		327,357,536	-	326,040,745	1,316,791

(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)

第2期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項 目	第1期 (2021年11月30日現在)	第2期 (2022年11月30日現在)
期首元本額	1,000,000円	38,535,757円
期中追加設定元本額	37,535,757円	379,344,235円
期中一部解約元本額	-円	56,234,121円

(4) 【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受 益証券	ゴールド・インデックス・マザーファ ンド	281,240,349	334,057,286	
	親投資信託受益証券 小計		334,057,286	
合 計			334,057,286	

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)

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

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

（1）貸借対照表

（単位：円）

	（2021年11月30日現在）	（2022年11月30日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	103,624,846	456,457,514
コール・ローン	3,056,237,624	2,816,383,083
株式	192,569,963,990	218,143,627,430
派生商品評価勘定	-	205,303,100
未収入金	-	209,436,600
未収配当金	1,330,297,687	1,741,212,622
前払金	133,950,000	-
差入委託証拠金	165,240,000	186,390,000
流動資産合計	197,359,314,147	223,758,810,349
資産合計		
	197,359,314,147	223,758,810,349
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	261,119,400	-
前受金	-	210,290,000
未払金	19,827,373	124,125,858
未払解約金	24,033,101	605,043,303
その他未払費用	14,521	10,581
流動負債合計	304,994,395	939,469,742
負債合計		
	304,994,395	939,469,742
純資産の部		
元本等		
元本	61,173,269,127	65,393,298,021
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	135,881,050,625	157,426,042,586
元本等合計	197,054,319,752	222,819,340,607
純資産合計	197,054,319,752	222,819,340,607
負債純資産合計	197,359,314,147	223,758,810,349

（2）注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 2021年12月1日 至 2022年11月30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11月30日現在）	（2022年11月30日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	61,173,269,127口	65,393,298,021口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.2212円 （1万口当たりの純資産額32,212円）	1口当たり純資産額 3.4074円 （1万口当たりの純資産額34,074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12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p>

	<p>2) デリバティブ取引</p> <p>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、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11月30日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券（株式）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p>

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物 0312月	5,076,959,400	-	4,815,840,000	261,119,400
	小計	5,076,959,400	-	4,815,840,000	261,119,400
合計		5,076,959,400	-	4,815,840,000	261,119,400

(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物 0412月	4,351,796,900	-	4,557,100,000	205,303,100
	小計	4,351,796,900	-	4,557,100,000	205,303,100
合計		4,351,796,900	-	4,557,100,000	205,303,100

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

（2021年11月30日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	60,972,880,728円
同期中における追加設定元本額	3,082,168,879円
同期中における一部解約元本額	2,881,780,480円
2021年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,444,432,886円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	893,111,379円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	4,314,610,252円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	3,302,572,824円
S M A M ・ グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	123,293,850円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	4,679,600円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	20,378,358円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）	62,968,056円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）	145,617,764円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）	123,379,159円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）	223,865,395円
国内株式指数ファンド（T O P I X）	1,383,108,545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	18,142,394,620円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	277,082,196円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	326,588,940円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	215,307,143円
イオン・バランス戦略ファンド	14,508,106円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2050	29,487,863円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	154,290,540円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	142,287,008円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	489,286,600円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	261,074,601円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	295,921,518円
三井住友・DCつみたてN I S A ・世界分散ファンド	33,623,909円
三井住友D S ・ 国内株式インデックス年金ファンド	440,586,720円
三井住友D S ・ 年金バランス30（債券重点型）	14,302,327円
三井住友D S ・ 年金バランス50（標準型）	71,078,321円
三井住友D S ・ 年金バランス70（株式重点型）	69,299,615円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2060	4,018,342円
日興F W S ・ 日本株インデックス	300,009,523円
三井住友D S ・ T O P I X インデックス・ファンド	1,878,586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）	2,839,797,359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＞	12,523,734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＞	108,824,691円
S M A M ・ バランスファンドV A 25＜適格機関投資家専用＞	1,852,669,865円
S M A M ・ バランスファンドV A 37.5＜適格機関投資家専用＞	1,648,623,694円
S M A M ・ バランスファンドV A 50＜適格機関投資家専用＞	6,291,332,987円
S M A M ・ バランスファンドV L 30＜適格機関投資家限定＞	41,040,556円
S M A M ・ バランスファンドV L 50＜適格機関投資家限定＞	166,358,728円
S M A M ・ バランスファンドV A 75＜適格機関投資家専用＞	748,263,991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 >	46,344,355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 >	259,277,705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 >	856,981,897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 >	603,670,244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 >	1,898,722,676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 >	42,261,700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 >	47,434,130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 >	34,163,089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 >	16,669,461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 >	115,063,306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 >	248,882,682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 >	61,933,489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 >	39,574,438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 >	7,375,595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 >	45,508,490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 >	613,464,436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)	180,359,966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 >	237,022,466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 >	110,132,461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 >	259,324,316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 >	64,476,018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 >	37,709,634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 >	55,155,389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 >	59,877,017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 >	197,029,085円
合 計	61,173,269,127円

(2022年11月30日現在)

開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	61,173,269,127円
同期中における追加設定元本額	11,653,465,066円
同期中における一部解約元本額	7,433,436,172円

2022年11月30日現在の元本の内訳

三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,574,760,676円
三井住友・D C 年金バランス3 0 (債券重点型)	1,036,137,254円
三井住友・D C 年金バランス5 0 (標準型)	4,637,683,641円
三井住友・D C 年金バランス7 0 (株式重点型)	3,605,989,911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)	147,542,223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)	4,234,860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)	19,508,324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)	63,979,125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)	165,870,052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)	149,775,143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)	266,593,539円
国内株式指数ファンド (T O P I X)	1,398,015,768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	22,016,808,347円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	179,974,667円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	253,617,658円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	167,938,880円
イオン・バランス戦略ファンド	20,272,782円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	41,931,085円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	191,067,731円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	178,416,019円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	669,872,498円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	375,434,831円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	427,891,807円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	49,851,584円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	813,757,842円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	39,664,361円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	202,349,704円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	191,586,051円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	5,500,206円
日興FWS・日本株インデックス	1,276,658,198円
三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド	18,140,230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)	2,564,092,115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>	11,882,906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>	74,050,540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>	1,456,182,387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>	1,446,188,375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>	5,623,103,466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>	37,493,396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>	135,694,110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>	684,565,549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>	44,118,775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>	254,234,553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>	796,235,497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>	533,449,238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>	1,657,079,267円
S M A M・バランスV A株40T <適格機関投資家限定>	372,784円
S M A M・グローバルバランス40V A <適格機関投資家限定>	36,667,207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>	39,482,192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>	32,479,210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>	16,795,425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>	95,429,547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>	219,105,114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>	52,522,560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>	38,723,328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>	7,680,964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>	41,326,285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>	542,525,688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)	167,317,059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>	202,591,112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>	85,721,825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 >	94,168,528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 >	44,811,453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 >	42,807,427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 >	5,577,900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 >	7,187,543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 >	92,673,351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 >	18,136,348円
合 計	65,393,298,021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	3,900	3,695.000	14,410,500	
日本水産	106,900	522.000	55,801,800	
マルハニチロ	16,200	2,456.000	39,787,200	
雪国まいたけ	10,600	1,001.000	10,610,600	
カネコ種苗	5,300	1,429.000	7,573,700	
サカタのタネ	13,500	4,690.000	63,315,000	
ホクト	9,400	1,890.000	17,766,000	
住石ホールディングス	21,800	254.000	5,537,200	
日鉄鉱業	4,300	3,145.000	13,523,500	
三井松島HLDGS	5,000	3,225.000	16,125,000	
I N P E X	394,000	1,533.000	604,002,000	
石油資源開発	12,300	4,335.000	53,320,500	
K & O エナジーグループ	4,900	2,427.000	11,892,300	
ショーボンドHD	14,500	6,060.000	87,870,000	
ミライト・ワン	37,200	1,514.000	56,320,800	
タマホーム	7,600	2,479.000	18,840,400	
日本アクア	5,900	880.000	5,192,000	
ROBOT HOME	800	184.000	147,200	
安藤・間	61,900	874.000	54,100,600	
東急建設	32,600	656.000	21,385,600	
コムシスホールディングス	35,900	2,467.000	88,565,300	
ビーアールホールディングス	22,200	337.000	7,481,400	
高松建設	7,200	1,960.000	14,112,000	
東建コーポレーション	3,400	7,950.000	27,030,000	
ヤマウラ	7,600	1,004.000	7,630,400	
オリエンタル白石	41,300	278.000	11,481,400	
大成建設	74,200	4,165.000	309,043,000	
大 林 組	265,900	1,024.000	272,281,600	
清水建設	223,600	738.000	165,016,800	
飛鳥建設	10,400	1,022.000	10,628,800	
長谷工コーポレーション	76,900	1,517.000	116,657,300	

松井建設	2,700	562.000	1,517,400
銭高組	2,100	2,686.000	5,640,600
鹿島建設	164,900	1,550.000	255,595,000
不動テトラ	6,000	1,524.000	9,144,000
大末建設	3,700	1,196.000	4,425,200
鉄建建設	7,000	1,819.000	12,733,000
西松建設	13,100	3,915.000	51,286,500
三井住友建設	63,200	422.000	26,670,400
大豊建設	3,300	4,440.000	14,652,000
奥村組	12,300	2,936.000	36,112,800
東鉄工業	10,300	2,552.000	26,285,600
浅沼組	6,300	2,920.000	18,396,000
戸田建設	92,700	732.000	67,856,400
熊谷組	13,000	2,539.000	33,007,000
北野建設	3,000	2,446.000	7,338,000
矢作建設	11,300	739.000	8,350,700
ピーエス三菱	11,100	603.000	6,693,300
日本ハウスHLDGS	17,800	437.000	7,778,600
新日本建設	10,700	748.000	8,003,600
東亜道路	1,700	6,100.000	10,370,000
日本道路	1,700	6,210.000	10,557,000
東亜建設	6,800	2,354.000	16,007,200
日本国土開発	23,700	572.000	13,556,400
若築建設	3,800	2,733.000	10,385,400
東洋建設	24,800	837.000	20,757,600
五洋建設	106,900	647.000	69,164,300
世紀東急	11,200	798.000	8,937,600
福田組	2,900	4,865.000	14,108,500
住友林業	57,200	2,371.000	135,621,200
巴コーポレーション	15,100	382.000	5,768,200
大和ハウス	208,400	3,159.000	658,335,600
ライト工業	13,500	2,068.000	27,918,000
積水ハウス	233,700	2,567.000	599,907,900
日特建設	8,000	911.000	7,288,000
ユアテック	16,600	719.000	11,935,400
日本リーテック	6,300	734.000	4,624,200
四電工	1,800	1,774.000	3,193,200
中電工	10,100	2,085.000	21,058,500
関電工	38,300	868.000	33,244,400
きんでん	51,500	1,471.000	75,756,500
東京エネシス	8,500	941.000	7,998,500
トーエネック	2,700	3,420.000	9,234,000
住友電設	6,900	2,540.000	17,526,000
日本電設工業	11,900	1,695.000	20,170,500
エクシオグループ	36,400	2,127.000	77,422,800
新日本空調	4,400	1,918.000	8,439,200
九電工	18,300	3,290.000	60,207,000
三機工業	16,200	1,598.000	25,887,600

日揮ホールディングス	74,100	1,893.000	140,271,300
中外炉工業	2,600	1,597.000	4,152,200
ヤマト	10,100	690.000	6,969,000
太平電業	4,800	3,145.000	15,096,000
高砂熱学	17,800	1,794.000	31,933,200
朝日工業社	3,500	2,132.000	7,462,000
明星工業	14,000	724.000	10,136,000
大 氣 社	8,900	3,535.000	31,461,500
ダイダン	5,100	2,200.000	11,220,000
日比谷総合設備	6,800	1,895.000	12,886,000
テスホールディングス	8,700	1,112.000	9,674,400
インフロニアHD	78,400	1,030.000	80,752,000
東洋エンジニア	11,200	582.000	6,518,400
レイズネクスト	10,500	1,255.000	13,177,500
ニッポン	19,400	1,587.000	30,787,800
日清製粉G本社	69,100	1,615.000	111,596,500
日東富士製粉	1,700	4,475.000	7,607,500
昭和産業	6,200	2,448.000	15,177,600
中部飼料	10,800	1,039.000	11,221,200
フィード・ワン	11,100	669.000	7,425,900
日本甜菜糖	5,300	1,627.000	8,623,100
DM三井製糖ホールディ	7,400	1,956.000	14,474,400
日新製糖	4,100	1,683.000	6,900,300
森永製菓	15,600	3,695.000	57,642,000
中 村 屋	2,900	3,110.000	9,019,000
江崎グリコ	21,600	3,585.000	77,436,000
名糖産業	1,600	1,610.000	2,576,000
井村屋グループ	4,400	2,231.000	9,816,400
不 二 家	5,000	2,633.000	13,165,000
山崎製パン	50,500	1,581.000	79,840,500
モロゾフ	2,700	3,590.000	9,693,000
亀田製菓	4,800	4,355.000	20,904,000
寿スピリッツ	8,000	7,770.000	62,160,000
カルビー	34,500	2,904.000	100,188,000
森永乳業	13,800	4,445.000	61,341,000
六甲バター	5,900	1,395.000	8,230,500
ヤクルト	53,500	8,750.000	468,125,000
明治ホールディングス	46,300	6,600.000	305,580,000
雪印メグミルク	18,600	1,729.000	32,159,400
プリマハム	9,900	2,041.000	20,205,900
日本ハム	29,300	3,700.000	108,410,000
丸大食品	8,600	1,425.000	12,255,000
S F o o d s	8,400	2,913.000	24,469,200
柿安本店	3,200	2,171.000	6,947,200
伊藤ハム米久HLDGS	53,400	684.000	36,525,600
サッポロホールディングス	24,800	3,590.000	89,032,000
アサヒグループホールディン	173,100	4,398.000	761,293,800
キリンHD	338,200	2,165.000	732,203,000

宝ホールディングス	51,000	1,068.000	54,468,000
オエノンホールディングス	25,600	282.000	7,219,200
コカ・コーラボトラーズJHD	58,900	1,460.000	85,994,000
サントリー食品インター	52,500	4,665.000	244,912,500
ダイドーグループHD	4,200	4,850.000	20,370,000
伊藤園	27,900	5,270.000	147,033,000
キーコーヒー	8,500	2,070.000	17,595,000
日清オイリオグループ	10,400	3,335.000	34,684,000
不二製油グループ	17,700	2,113.000	37,400,100
かどや製油	2,900	3,500.000	10,150,000
J-オイルミルズ	7,800	1,514.000	11,809,200
キッコーマン	49,500	7,720.000	382,140,000
味の素	183,400	4,335.000	795,039,000
ブルドックソ-ス	3,500	1,720.000	6,020,000
キューピー	40,200	2,447.000	98,369,400
ハウス食品G本社	22,900	2,714.000	62,150,600
カゴメ	35,000	3,050.000	106,750,000
焼津水産化工	11,700	832.000	9,734,400
アリアケジャパン	6,600	4,605.000	30,393,000
ニチレイ	34,600	2,781.000	96,222,600
東洋水産	37,800	5,770.000	218,106,000
イトアンドHLDGS	3,900	2,232.000	8,704,800
日清食品HD	26,600	10,480.000	278,768,000
永谷園ホールディングス	4,100	2,003.000	8,212,300
フジッコ	7,800	1,895.000	14,781,000
ロックフィールド	9,600	1,476.000	14,169,600
日本たばこ産業	492,900	2,815.500	1,387,759,950
ケンコーマヨネーズ	5,500	1,651.000	9,080,500
わらべや日洋HD	6,100	1,848.000	11,272,800
なとり	5,200	2,060.000	10,712,000
ファーマフーズ	11,800	1,285.000	15,163,000
ユーグレナ	49,300	901.000	44,419,300
紀文食品	6,900	943.000	6,506,700
ピクルスホールディングス	1,500	1,083.000	1,624,500
ミヨシ油脂	3,800	986.000	3,746,800
理研ビタミン	6,800	1,776.000	12,076,800
片倉工業	8,200	1,975.000	16,195,000
グンゼ	5,800	3,980.000	23,084,000
東洋紡	34,300	1,035.000	35,500,500
ユニチカ	27,800	268.000	7,450,400
富士紡ホールディングス	3,200	3,385.000	10,832,000
倉敷紡績	6,100	2,179.000	13,291,900
シキボウ	7,900	878.000	6,936,200
日本毛織	22,200	1,008.000	22,377,600
帝国繊維	9,000	1,663.000	14,967,000
帝人	73,500	1,328.000	97,608,000
東レ	511,500	738.600	377,793,900
アツギ	3,000	380.000	1,140,000

ダイニック	6,300	619.000	3,899,700
セーレン	14,700	2,623.000	38,558,100
小松マテーレ	12,300	799.000	9,827,700
ワコールホールディングス	14,900	2,329.000	34,702,100
ホギメディカル	10,300	3,490.000	35,947,000
T S Iホールディングス	29,100	481.000	13,997,100
ワールド	10,400	1,315.000	13,676,000
三陽商会	4,000	1,322.000	5,288,000
オンワードホールディングス	52,100	330.000	17,193,000
ルックホールディングス	3,400	2,497.000	8,489,800
ゴ-ルドウイン	13,400	9,420.000	126,228,000
デサント	13,100	3,350.000	43,885,000
特種東海製紙	4,300	2,833.000	12,181,900
王子ホールディングス	316,800	528.000	167,270,400
日本製紙	40,300	965.000	38,889,500
北越コーポレーション	48,300	777.000	37,529,100
大王製紙	34,200	1,064.000	36,388,800
レンゴー	70,500	866.000	61,053,000
トーモク	5,400	1,600.000	8,640,000
ザ・バック	6,000	2,521.000	15,126,000
北の達人コーポ	34,500	302.000	10,419,000
ク ラ レ	121,000	1,096.000	132,616,000
旭 化 成	475,300	1,019.000	484,330,700
昭和電工	73,700	2,188.000	161,255,600
住友化学	562,900	498.000	280,324,200
住友精化	3,300	4,240.000	13,992,000
日産化学	36,100	6,740.000	243,314,000
ラサ工業	3,400	2,117.000	7,197,800
クレハ	6,500	9,730.000	63,245,000
多木化学	3,000	5,250.000	15,750,000
テイカ	5,400	1,275.000	6,885,000
石原産業	14,300	1,121.000	16,030,300
日本曹達	8,200	4,280.000	35,096,000
東ソー	101,200	1,623.000	164,247,600
トクヤマ	25,000	1,913.000	47,825,000
セントラル硝子	12,300	3,495.000	42,988,500
東亜合成	38,800	1,177.000	45,667,600
大阪ソーダ	4,600	4,130.000	18,998,000
関東電化	15,300	1,026.000	15,697,800
デンカ	27,700	3,310.000	91,687,000
信越化学	130,300	17,570.000	2,289,371,000
日本カ-バイド	4,400	1,307.000	5,750,800
堺 化 学	6,200	1,879.000	11,649,800
第一稀元素化学工	7,600	1,203.000	9,142,800
エア・ウォーター	71,800	1,615.000	115,957,000
日本酸素H L D G S	73,300	2,273.000	166,610,900
日本化学工業	3,200	1,858.000	5,945,600
日本パ-カラライジング	36,600	991.000	36,270,600

高圧ガス	12,000	648.000	7,776,000
四国化成	9,200	1,351.000	12,429,200
ステラ ケミファ	4,800	2,617.000	12,561,600
保土谷化学	2,500	3,105.000	7,762,500
日本触媒	11,600	5,510.000	63,916,000
大日精化	5,700	1,717.000	9,786,900
カネカ	17,200	3,500.000	60,200,000
三菱瓦斯化学	56,500	1,961.000	110,796,500
三井化学	63,700	3,100.000	197,470,000
J S R	71,200	2,873.000	204,557,600
東京応化工業	13,300	6,840.000	90,972,000
大阪有機化学	5,900	2,113.000	12,466,700
三菱ケミカルグループ	515,300	729.200	375,756,760
K Hネオケム	12,700	2,767.000	35,140,900
ダイセル	112,200	998.000	111,975,600
住友ベークライト	11,200	4,320.000	48,384,000
積水化学	157,200	1,927.000	302,924,400
日本ゼオン	45,700	1,325.000	60,552,500
アイカ工業	19,200	3,235.000	62,112,000
U B E	39,300	1,999.000	78,560,700
積水樹脂	10,700	1,809.000	19,356,300
タキロンシーアイ	16,800	508.000	8,534,400
旭有機材	5,200	2,654.000	13,800,800
ニチバン	5,300	1,754.000	9,296,200
リケンテクノス	17,400	499.000	8,682,600
大倉工業	4,000	2,014.000	8,056,000
群栄化学	2,200	2,424.000	5,332,800
ミライアル	3,600	1,716.000	6,177,600
ダイキョーニシカワ	17,400	590.000	10,266,000
森六ホールディングス	4,400	1,757.000	7,730,800
恵和	2,500	3,725.000	9,312,500
日本化薬	58,100	1,248.000	72,508,800
カーリットホールディングス	8,500	719.000	6,111,500
日本精化	4,300	2,238.000	9,623,400
扶桑化学工業	6,900	3,525.000	24,322,500
トリケミカル	10,300	2,411.000	24,833,300
A D E K A	26,200	2,252.000	59,002,400
日油	23,500	5,780.000	135,830,000
新日本理化	19,100	255.000	4,870,500
ハリマ化成グループ	6,600	841.000	5,550,600
花王	185,700	5,461.000	1,014,107,700
第一工業製薬	3,400	2,009.000	6,830,600
石原ケミカル	4,100	1,234.000	5,059,400
ニイタカ	2,100	2,095.000	4,399,500
三洋化成	4,500	4,405.000	19,822,500
大日本塗料	11,800	767.000	9,050,600
日本ペイントHOLD	336,900	1,120.000	377,328,000
関西ペイント	70,000	1,877.000	131,390,000

中国塗料	14,900	1,033.000	15,391,700
日本特殊塗料	6,200	872.000	5,406,400
藤倉化成	4,000	409.000	1,636,000
太陽ホールディングス	11,500	2,539.000	29,198,500
D I C	29,700	2,506.000	74,428,200
サカティンクス	17,000	1,105.000	18,785,000
東洋インキS Cホールディン	14,300	1,880.000	26,884,000
T & K T O K A	7,400	1,002.000	7,414,800
富士フィルムH L D G S	146,300	7,315.000	1,070,184,500
資 生 堂	159,400	5,799.000	924,360,600
ライオン	92,100	1,465.000	134,926,500
高砂香料	5,200	2,844.000	14,788,800
マンダム	17,000	1,438.000	24,446,000
ミルボン	11,400	5,700.000	64,980,000
ファンケル	33,400	2,566.000	85,704,400
コーセー	15,500	14,490.000	224,595,000
コタ	6,300	1,683.000	10,602,900
ポーラ・オルビスHD	39,300	1,786.000	70,189,800
ノエビアホールディングス	6,800	5,830.000	39,644,000
新日本製薬	4,800	1,373.000	6,590,400
エステー	6,600	1,538.000	10,150,800
コ ニ シ	12,600	1,723.000	21,709,800
長谷川香料	15,700	3,075.000	48,277,500
小林製薬	23,300	8,500.000	198,050,000
荒川化学工業	7,500	995.000	7,462,500
メック	6,300	2,571.000	16,197,300
日本高純度化学	2,400	2,504.000	6,009,600
タカラバイオ	20,500	1,801.000	36,920,500
J C U	8,600	3,370.000	28,982,000
新田ゼラチン	5,900	1,076.000	6,348,400
O A T アグリオ	3,500	1,776.000	6,216,000
デクセリアルズ	22,100	3,230.000	71,383,000
アース製薬	6,900	5,320.000	36,708,000
北興化学	9,700	909.000	8,817,300
大成ラミック	3,900	3,075.000	11,992,500
クミアイ化学	30,700	923.000	28,336,100
日本農薬	14,500	749.000	10,860,500
アキレス	6,000	1,351.000	8,106,000
有沢製作所	13,000	1,284.000	16,692,000
日東電工	55,200	8,610.000	475,272,000
レック	11,800	813.000	9,593,400
三光合成	12,500	459.000	5,737,500
き も と	19,400	238.000	4,617,200
藤森工業	5,900	3,195.000	18,850,500
前澤化成工業	6,200	1,385.000	8,587,000
未来工業	3,200	1,488.000	4,761,600
ジェイ エス ビー	5,600	1,487.000	8,327,200
エフピコ	14,600	3,785.000	55,261,000

天馬	6,400	2,083.000	13,331,200
信越ポリマー	13,800	1,247.000	17,208,600
東リ	9,100	211.000	1,920,100
ニフコ	27,400	3,590.000	98,366,000
バルカー	6,500	2,730.000	17,745,000
ユニ・チャーム	159,000	5,083.000	808,197,000
協和キリン	91,800	3,175.000	291,465,000
武田薬品	675,000	4,050.000	2,733,750,000
アステラス製薬	730,900	2,128.000	1,555,355,200
住友ファーマ	56,900	1,067.000	60,712,300
塩野義製薬	97,600	6,950.000	678,320,000
日本新薬	18,000	8,090.000	145,620,000
中外製薬	238,500	3,624.000	864,324,000
科研製薬	13,300	3,940.000	52,402,000
エーザイ	92,900	9,332.000	866,942,800
ロート製薬	37,000	4,490.000	166,130,000
小野薬品	147,300	3,516.000	517,906,800
久光製薬	17,200	3,870.000	66,564,000
持田製薬	8,900	3,380.000	30,082,000
参天製薬	144,000	1,114.000	160,416,000
扶桑薬品	3,200	2,047.000	6,550,400
ツムラ	24,100	2,999.000	72,275,900
キッセイ薬品工業	11,800	2,534.000	29,901,200
生化学工業	13,500	943.000	12,730,500
栄研化学	11,900	1,903.000	22,645,700
鳥居薬品	4,000	2,902.000	11,608,000
JCRファーマ	26,200	1,912.000	50,094,400
東和薬品	11,900	2,112.000	25,132,800
富士製薬工業	6,600	1,019.000	6,725,400
ゼリア新薬工業	10,500	2,226.000	23,373,000
第一三共	664,400	4,518.000	3,001,759,200
キョーリン製薬HD	16,600	1,770.000	29,382,000
大幸薬品	15,900	523.000	8,315,700
ダイト	5,400	2,594.000	14,007,600
大塚ホールディングス	174,400	4,690.000	817,936,000
大正製薬HD	17,500	5,600.000	98,000,000
ペプチドリーム	37,400	1,712.000	64,028,800
あすか製薬HD	8,400	1,279.000	10,743,600
サワイグループHD	17,400	4,240.000	73,776,000
日本コークス工業	81,600	88.000	7,180,800
ニチレキ	9,400	1,295.000	12,173,000
ユシロ化学	10,500	828.000	8,694,000
富士石油	20,000	275.000	5,500,000
出光興産	84,400	3,240.000	273,456,000
ENEOSホールディングス	1,378,600	466.000	642,427,600
コスモエネルギーHLDGS	29,000	3,880.000	112,520,000
横浜ゴム	43,300	2,255.000	97,641,500
TOYO TIRE	44,100	1,567.000	69,104,700

ブリヂストン	243,500	5,167.000	1,258,164,500
住友ゴム	75,200	1,188.000	89,337,600
藤倉コンポジット	6,600	847.000	5,590,200
オカモト	4,500	3,850.000	17,325,000
ニッタ	7,600	2,930.000	22,268,000
住友理工	15,600	616.000	9,609,600
三ツ星ベルト	11,300	3,430.000	38,759,000
バンドー化学	12,700	999.000	12,687,300
日東紡績	9,400	2,184.000	20,529,600
A G C	77,400	4,600.000	356,040,000
日本電気硝子	31,500	2,532.000	79,758,000
オハラ	5,000	1,265.000	6,325,000
住友大阪セメント	11,300	3,235.000	36,555,500
太平洋セメント	49,100	2,167.000	106,399,700
日本ヒユ - ム	9,500	648.000	6,156,000
日本コンクリ - ト	22,500	234.000	5,265,000
三谷セキサン	3,600	4,210.000	15,156,000
アジアパイルHD	15,100	536.000	8,093,600
東海カーボン	64,800	1,047.000	67,845,600
日本カーボン	4,600	4,335.000	19,941,000
東洋炭素	4,900	3,930.000	19,257,000
ノリタケ	4,200	4,040.000	16,968,000
T O T O	50,200	4,745.000	238,199,000
日本碍子	89,700	1,811.000	162,446,700
日本特殊陶業	58,200	2,680.000	155,976,000
M A R U W A	3,000	18,820.000	56,460,000
品川リフラクトリーズ	2,300	3,945.000	9,073,500
黒崎播磨	1,800	5,030.000	9,054,000
ヨータイ	5,000	1,376.000	6,880,000
東京窯業	22,500	270.000	6,075,000
フジインコーポレーテッド	6,500	7,020.000	45,630,000
ニチアス	20,000	2,418.000	48,360,000
ニチハ	9,900	2,823.000	27,947,700
日本製鉄	351,200	2,192.500	770,006,000
神戸製鋼所	173,000	620.000	107,260,000
中山製鋼所	17,300	755.000	13,061,500
合同製鐵	4,400	1,903.000	8,373,200
J F Eホールディングス	215,000	1,526.000	328,090,000
東京製鐵	21,900	1,403.000	30,725,700
共英製鋼	13,000	1,293.000	16,809,000
大和工業	14,800	4,710.000	69,708,000
東京鐵鋼	4,500	1,412.000	6,354,000
大阪製鐵	5,600	1,135.000	6,356,000
淀川製鋼所	8,400	2,543.000	21,361,200
丸一鋼管	27,200	2,843.000	77,329,600
モリ工業	2,800	2,813.000	7,876,400
大同特殊鋼	12,000	4,415.000	52,980,000
日本冶金工	5,900	4,305.000	25,399,500

山陽特殊製鋼	7,600	2,213.000	16,818,800
愛知製鋼	7,000	2,273.000	15,911,000
大太平洋金属	8,000	2,050.000	16,400,000
新日本電工	52,100	422.000	21,986,200
栗本鉄工所	4,400	1,796.000	7,902,400
三菱製鋼	6,100	995.000	6,069,500
日本精線	2,000	4,365.000	8,730,000
エンビプロHD	10,000	720.000	7,200,000
新家工業	3,100	2,312.000	7,167,200
大紀アルミニウム	11,100	1,295.000	14,374,500
日本軽金属HD	21,700	1,532.000	33,244,400
三井金属	22,900	3,135.000	71,791,500
東邦亜鉛	5,100	2,159.000	11,010,900
三菱マテリアル	52,600	2,187.000	115,036,200
住友鉱山	91,100	4,645.000	423,159,500
DOWAホールディングス	17,900	4,520.000	80,908,000
古河機金	11,100	1,291.000	14,330,100
大阪チタニウム	11,700	4,195.000	49,081,500
東邦チタニウム	14,400	2,748.000	39,571,200
UACJ	11,100	2,305.000	25,585,500
CKサンエツ	2,200	4,225.000	9,295,000
古河電工	26,300	2,597.000	68,301,100
住友電工	270,600	1,600.500	433,095,300
フジクラ	85,300	1,117.000	95,280,100
昭和電線HLDGS	8,900	1,795.000	15,975,500
タツタ電線	16,100	431.000	6,939,100
平河ヒューテック	5,000	1,098.000	5,490,000
リョービ	8,900	1,243.000	11,062,700
アサヒHD	31,700	2,044.000	64,794,800
稲葉製作所	8,900	1,387.000	12,344,300
宮地エンジニアリングG	2,500	3,405.000	8,512,500
トーカロ	21,400	1,242.000	26,578,800
アルファCO	7,400	957.000	7,081,800
SUMCO	149,400	2,023.000	302,236,200
川田テクノロジーズ	2,200	3,370.000	7,414,000
RS TECHNOLOGIES	2,600	8,200.000	21,320,000
信和	11,200	789.000	8,836,800
東洋製罐グループHD	52,000	1,594.000	82,888,000
ホッカンホールディングス	5,800	1,323.000	7,673,400
横河ブリッジHLDGS	10,300	1,933.000	19,909,900
三和ホールディングス	72,000	1,290.000	92,880,000
文化シャツタ-	22,600	1,124.000	25,402,400
三協立山	12,500	565.000	7,062,500
アルインコ	7,500	1,000.000	7,500,000
LIXIL	114,200	2,109.000	240,847,800
ノーリツ	11,700	1,484.000	17,362,800
長府製作所	7,900	1,972.000	15,578,800
リンナイ	14,200	10,180.000	144,556,000

日東精工	12,500	523.000	6,537,500
岡 部	14,200	719.000	10,209,800
ジーテクト	8,600	1,534.000	13,192,400
東 プ レ	13,900	1,259.000	17,500,100
高周波熱錬	14,500	680.000	9,860,000
東京製網	5,800	891.000	5,167,800
サンコール	8,400	636.000	5,342,400
モリテックスチル	8,800	245.000	2,156,000
パイオラックス	11,100	1,740.000	19,314,000
日本発条	69,500	915.000	63,592,500
三益半導体	7,000	2,558.000	17,906,000
日本製鋼所	21,400	2,920.000	62,488,000
三浦工業	32,200	3,260.000	104,972,000
タ ク マ	24,000	1,276.000	30,624,000
ツ ガ ミ	17,400	1,184.000	20,601,600
オークマ	7,700	5,210.000	40,117,000
芝浦機械	8,700	2,742.000	23,855,400
アマダ	121,600	1,098.000	133,516,800
アイダエンジニア	16,300	835.000	13,610,500
F U J I	33,300	2,074.000	69,064,200
牧野フライス	8,500	4,615.000	39,227,500
オーエスジー	36,900	1,936.000	71,438,400
旭ダイヤモンド	23,100	720.000	16,632,000
D M G 森精機	46,800	1,831.000	85,690,800
ソディック	21,000	763.000	16,023,000
ディスコ	12,300	40,600.000	499,380,000
日東工器	4,400	1,526.000	6,714,400
日進工具	6,700	1,127.000	7,550,900
パンチ工業	3,300	421.000	1,389,300
豊和工業	6,500	881.000	5,726,500
石川製作所	3,500	1,451.000	5,078,500
島精機製作所	12,300	2,092.000	25,731,600
オプトラン	11,600	2,547.000	29,545,200
N C ホールディングス	2,500	2,096.000	5,240,000
イワキポンプ	5,700	1,307.000	7,449,900
フリー	8,900	1,155.000	10,279,500
ヤマシンフィルタ	20,400	482.000	9,832,800
日阪製作所	9,100	818.000	7,443,800
やまびこ	13,100	1,134.000	14,855,400
野村マイクロ・サイエンス	2,600	4,705.000	12,233,000
平田機工	3,800	5,470.000	20,786,000
ペガサスミシン製造	9,600	967.000	9,283,200
マルマエ	4,200	1,901.000	7,984,200
タツモ	5,000	1,766.000	8,830,000
ナプテスコ	48,400	3,410.000	165,044,000
三井海洋開発	9,900	1,529.000	15,137,100
レオン自動機	8,700	1,170.000	10,179,000
S M C	24,900	61,760.000	1,537,824,000

ホソカワミクロン	6,100	2,944.000	17,958,400
ユニオンツール	3,300	3,510.000	11,583,000
オイレス工業	10,900	1,494.000	16,284,600
日精エーエスピー	3,600	4,210.000	15,156,000
サト - ホールディングス	11,100	1,954.000	21,689,400
技研製作所	8,200	3,285.000	26,937,000
日本エアージェット	5,300	1,172.000	6,211,600
日精樹脂工業	7,200	957.000	6,890,400
オカダアイヨン	1,400	1,547.000	2,165,800
ワイエイシイホールディングス	4,100	1,466.000	6,010,600
小松製作所	360,000	3,179.000	1,144,440,000
住友重機械	45,300	2,912.000	131,913,600
日立建機	30,600	3,210.000	98,226,000
日 工	13,700	620.000	8,494,000
巴工業	4,000	2,418.000	9,672,000
井関農機	8,500	1,277.000	10,854,500
T O W A	8,100	1,969.000	15,948,900
ローツェ	4,000	8,390.000	33,560,000
クボタ	406,500	2,030.000	825,195,000
荏原実業	4,000	2,267.000	9,068,000
三菱化工機	3,100	2,116.000	6,559,600
月島機械	11,600	981.000	11,379,600
帝国電機製作所	6,100	2,367.000	14,438,700
新東工業	17,100	670.000	11,457,000
渋谷工業	7,200	2,478.000	17,841,600
アイチ コーポレーション	11,500	800.000	9,200,000
小森コーポレーション	19,200	814.000	15,628,800
鶴見製作所	6,100	1,996.000	12,175,600
酒井重工業	1,800	3,525.000	6,345,000
荏原製作所	31,400	5,260.000	165,164,000
西島製作所	7,700	1,550.000	11,935,000
北越工業	8,800	1,153.000	10,146,400
ダイキン工業	91,700	22,405.000	2,054,538,500
オルガノ	10,500	2,818.000	29,589,000
ト - ヨ - カネツ	3,700	2,487.000	9,201,900
栗田工業	42,900	6,100.000	261,690,000
椿本チエイン	10,600	3,145.000	33,337,000
大同工業	7,900	770.000	6,083,000
木村化工機	8,600	700.000	6,020,000
アネスト岩田	13,900	944.000	13,121,600
ダイフク	39,600	7,040.000	278,784,000
サムコ	2,700	3,865.000	10,435,500
タダノ	41,400	980.000	40,572,000
フジテック	28,200	3,010.000	84,882,000
C K D	21,300	2,043.000	43,515,900
平和	25,800	2,445.000	63,081,000
理想科学工業	7,000	2,378.000	16,646,000
S A N K Y O	15,300	5,360.000	82,008,000

日本金銭機械	10,500	1,014.000	10,647,000
マースグループHLDGS	5,500	2,050.000	11,275,000
フクシマガリレイ	5,700	4,350.000	24,795,000
ダイコク電機	5,400	1,606.000	8,672,400
竹内製作所	14,000	3,175.000	44,450,000
アマノ	22,000	2,475.000	54,450,000
JUKI	13,800	671.000	9,259,800
ジャノメ	9,800	620.000	6,076,000
マックス	9,400	2,059.000	19,354,600
グローリー	20,400	2,304.000	47,001,600
新晃工業	8,300	1,548.000	12,848,400
大和冷機工業	11,600	1,225.000	14,210,000
セガサミーホールディングス	62,000	1,823.000	113,026,000
日本ピストンリング	1,200	1,208.000	1,449,600
リケン	3,800	2,277.000	8,652,600
TPR	9,800	1,232.000	12,073,600
ツバキ・ナカシマ	18,000	1,035.000	18,630,000
ホシザキ	49,500	4,635.000	229,432,500
大豊工業	8,000	699.000	5,592,000
日本精工	141,200	760.000	107,312,000
NTN	155,100	290.000	44,979,000
ジェイテクト	68,000	1,010.000	68,680,000
不二越	5,700	3,870.000	22,059,000
日本トムソン	20,400	609.000	12,423,600
THK	44,400	2,669.000	118,503,600
前澤給装工業	6,800	933.000	6,344,400
イーグル工業	9,200	1,109.000	10,202,800
日本ピラ - 工業	7,300	2,765.000	20,184,500
キッツ	29,000	844.000	24,476,000
マキタ	95,900	3,130.000	300,167,000
日立造船	63,500	896.000	56,896,000
三菱重工業	134,500	5,457.000	733,966,500
IHI	48,500	3,760.000	182,360,000
スター精密	14,600	1,755.000	25,623,000
日清紡ホールディングス	63,300	1,014.000	64,186,200
イビデン	44,000	5,510.000	242,440,000
コニカミノルタ	173,400	569.000	98,664,600
ブラザー工業	102,200	2,214.000	226,270,800
ミネベアミツミ	133,000	2,243.000	298,319,000
日立	385,500	7,299.000	2,813,764,500
東芝	147,900	4,690.000	693,651,000
三菱電機	793,700	1,377.500	1,093,321,750
富士電機	46,600	5,620.000	261,892,000
安川電機	90,900	4,445.000	404,050,500
シンフォニアテクノロジー	9,200	1,507.000	13,864,400
明電舎	12,000	1,987.000	23,844,000
オリジン	3,700	1,316.000	4,869,200
山洋電気	3,500	6,200.000	21,700,000

デンヨー	6,600	1,500.000	9,900,000
PHCホールディングス	10,900	1,595.000	17,385,500
ソシオネクスト	7,500	6,670.000	50,025,000
東芝テック	11,400	3,695.000	42,123,000
芝浦メカトロニクス	1,500	10,980.000	16,470,000
マブチモーター	19,000	4,130.000	78,470,000
日本電産	186,600	8,534.000	1,592,444,400
トレックス・セミコンダクター	3,900	2,926.000	11,411,400
東光高岳	5,200	1,847.000	9,604,400
ダブル・スコープ	19,500	1,868.000	36,426,000
ダイヘン	7,100	4,080.000	28,968,000
ヤーマン	15,700	1,306.000	20,504,200
JVCケンウッド	75,600	370.000	27,972,000
ミマキエンジニアリング	8,500	654.000	5,559,000
I - P E X	5,300	1,309.000	6,937,700
日新電機	18,100	1,341.000	24,272,100
大崎電気	21,400	533.000	11,406,200
オムロン	70,400	7,044.000	495,897,600
日東工業	10,500	2,331.000	24,475,500
I D E C	11,500	3,265.000	37,547,500
ジーエス・ユアサ コーポ	25,600	2,161.000	55,321,600
メルコホールディングス	2,300	3,110.000	7,153,000
日本電気	108,600	4,855.000	527,253,000
富士通	76,500	18,465.000	1,412,572,500
沖電気	36,600	728.000	26,644,800
電気興業	4,000	2,100.000	8,400,000
サンケン電気	7,200	6,630.000	47,736,000
アイホン	5,100	1,917.000	9,776,700
ルネサスエレクトロニクス	500,900	1,316.000	659,184,400
セイコーエプソン	102,200	2,152.000	219,934,400
ワコム	61,400	648.000	39,787,200
アルバック	18,300	5,930.000	108,519,000
アクセル	4,000	1,507.000	6,028,000
E I Z O	5,800	3,595.000	20,851,000
日本信号	17,800	1,033.000	18,387,400
京三製作所	19,400	414.000	8,031,600
能美防災	10,400	1,590.000	16,536,000
ホーチキ	6,400	1,445.000	9,248,000
エレコム	18,500	1,452.000	26,862,000
パナソニック ホールディング	907,300	1,274.000	1,155,900,200
シャープ	92,800	973.000	90,294,400
アンリツ	54,600	1,466.000	80,043,600
富士通ゼネラル	21,900	3,235.000	70,846,500
ソニーグループ	537,900	11,255.000	6,054,064,500
T D K	121,600	4,880.000	593,408,000
帝国通信工業	4,300	1,403.000	6,032,900
タムラ製作所	34,100	816.000	27,825,600
アルプスアルパイン	69,600	1,302.000	90,619,200

日本電波工業	9,600	1,745.000	16,752,000
鈴木	3,000	919.000	2,757,000
メイコー	8,600	3,005.000	25,843,000
日本トリム	2,400	2,462.000	5,908,800
ローランド ディー . ジー .	4,500	3,085.000	13,882,500
フオスタ - 電機	9,100	961.000	8,745,100
S M K	2,300	2,639.000	6,069,700
ヨコオ	6,400	2,414.000	15,449,600
ホシデン	18,700	1,626.000	30,406,200
ヒロセ電機	12,700	18,200.000	231,140,000
日本航空電子	15,700	2,347.000	36,847,900
T O A	10,300	766.000	7,889,800
マクセル	17,400	1,410.000	24,534,000
古野電気	10,700	1,020.000	10,914,000
スミダコーポレーション	8,000	1,462.000	11,696,000
アイコム	3,200	2,785.000	8,912,000
リオン	3,600	2,050.000	7,380,000
横河電機	84,000	2,566.000	215,544,000
新電元工業	3,200	3,335.000	10,672,000
アズビル	53,100	4,175.000	221,692,500
東亜ディーケーケー	7,600	849.000	6,452,400
日本光電工業	35,300	3,195.000	112,783,500
チノール	4,200	1,840.000	7,728,000
日本電子材料	6,400	1,542.000	9,868,800
堀場製作所	17,000	6,240.000	106,080,000
アドバンテスト	59,800	9,130.000	545,974,000
エスベック	6,600	2,058.000	13,582,800
キーエンス	76,100	57,140.000	4,348,354,000
日置電機	4,000	6,820.000	27,280,000
シスメックス	65,500	8,318.000	544,829,000
日本マイクロニクス	12,900	1,459.000	18,821,100
メガチップス	6,500	2,645.000	17,192,500
O B A R A G R O U P	4,400	3,485.000	15,334,000
コーセル	11,500	851.000	9,786,500
イリソ電子工業	7,100	4,760.000	33,796,000
オプテックスグループ	14,300	2,146.000	30,687,800
千代田インテグレ	4,300	2,407.000	10,350,100
レーザーテック	37,500	25,135.000	942,562,500
スタンレー電気	54,000	2,793.000	150,822,000
岩崎電気	3,100	2,546.000	7,892,600
ウシオ電機	40,000	1,782.000	71,280,000
ヘリオステクノH	11,500	446.000	5,129,000
エノモト	2,500	1,942.000	4,855,000
日本セラミック	8,000	2,647.000	21,176,000
古河電池	6,200	1,123.000	6,962,600
双信電機	2,800	425.000	1,190,000
山一電機	7,100	1,845.000	13,099,500
図研	6,700	3,290.000	22,043,000

日本電子	19,000	4,560.000	86,640,000
カシオ	57,100	1,340.000	76,514,000
ファナック	74,600	20,365.000	1,519,229,000
日本シイエムケイ	18,600	578.000	10,750,800
エンプラス	2,400	4,470.000	10,728,000
大真空	10,200	839.000	8,557,800
ローム	35,100	10,850.000	380,835,000
浜松ホトニクス	60,800	7,160.000	435,328,000
三井ハイテック	7,900	7,960.000	62,884,000
新光電気工業	26,800	3,805.000	101,974,000
京セラ	118,100	6,981.000	824,456,100
太陽誘電	37,000	4,365.000	161,505,000
村田製作所	230,500	7,464.000	1,720,452,000
双葉電子工業	17,600	592.000	10,419,200
北陸電気工業	1,600	1,290.000	2,064,000
ニチコン	15,900	1,414.000	22,482,600
日本ケミコン	8,100	1,841.000	14,912,100
K O A	11,800	2,199.000	25,948,200
市光工業	12,900	426.000	5,495,400
小糸製作所	91,100	2,165.000	197,231,500
ミツバ	16,500	533.000	8,794,500
S C R E E Nホールディングス	13,000	9,030.000	117,390,000
キャノン電子	8,700	1,580.000	13,746,000
キャノン	417,300	3,212.000	1,340,367,600
リコー	190,000	1,086.000	206,340,000
象印マホービン	22,700	1,599.000	36,297,300
東京エレクトロン	53,600	45,090.000	2,416,824,000
イノテック	6,000	1,302.000	7,812,000
トヨタ紡織	32,000	1,911.000	61,152,000
ユニプレス	15,000	882.000	13,230,000
豊田自動織機	55,300	7,810.000	431,893,000
モリタホールディングス	14,000	1,266.000	17,724,000
三桜工業	12,500	669.000	8,362,500
デンソー	156,700	7,514.000	1,177,443,800
東海理化電機	20,900	1,552.000	32,436,800
川崎重工業	57,600	2,926.000	168,537,600
日本車輛	3,700	1,965.000	7,270,500
三菱ロジスネクスト	14,000	894.000	12,516,000
日産自動車	1,081,700	491.200	531,331,040
いすゞ自動車	220,600	1,794.000	395,756,400
トヨタ自動車	4,175,600	2,010.500	8,395,043,800
日野自動車	99,000	620.000	61,380,000
三菱自動車工業	297,800	636.000	189,400,800
武蔵精密工業	18,600	1,768.000	32,884,800
日産車体	13,700	832.000	11,398,400
新明和工業	24,700	1,013.000	25,021,100
極東開発工業	13,700	1,363.000	18,673,100
トピー工業	6,900	1,730.000	11,937,000

ティラド	2,500	2,648.000	6,620,000
曙ブレーキ	53,400	165.000	8,811,000
タチエス	13,100	1,096.000	14,357,600
N O K	30,000	1,264.000	37,920,000
フタバ産業	24,000	375.000	9,000,000
K Y B	7,400	3,625.000	26,825,000
大同メタル工業	19,600	495.000	9,702,000
プレス工業	35,700	451.000	16,100,700
ミクニ	13,500	340.000	4,590,000
太平洋工業	17,900	1,079.000	19,314,100
アイシン	58,300	3,765.000	219,499,500
マ ッ ダ	252,000	1,091.000	274,932,000
本田技研	618,000	3,356.000	2,074,008,000
スズキ	139,800	4,913.000	686,837,400
S U B A R U	241,100	2,351.500	566,946,650
ヤマハ発動機	119,200	3,415.000	407,068,000
T B K	18,500	261.000	4,828,500
エクセディ	12,700	1,668.000	21,183,600
豊田合成	22,200	2,282.000	50,660,400
愛三工業	13,800	702.000	9,687,600
日本プラスト	15,900	427.000	6,789,300
ヨ ロ ズ	9,000	805.000	7,245,000
エフ・シー・シー	13,400	1,425.000	19,095,000
シマノ	31,100	23,380.000	727,118,000
テイ・エス テック	34,900	1,607.000	56,084,300
ジャムコ	2,400	1,611.000	3,866,400
テ ル モ	237,500	4,043.000	960,212,500
日 機 装	19,500	1,001.000	19,519,500
日本エム・ディ・エム	5,000	1,036.000	5,180,000
島津製作所	92,300	4,180.000	385,814,000
長野計器	6,400	1,155.000	7,392,000
ブイ・テクノロジー	4,100	2,693.000	11,041,300
東京計器	7,000	1,177.000	8,239,000
愛知時計	3,800	1,369.000	5,202,200
インターアクション	5,100	1,583.000	8,073,300
オーバル	8,000	502.000	4,016,000
東京精密	16,600	4,340.000	72,044,000
マニー	33,600	2,260.000	75,936,000
ニコン	118,400	1,334.000	157,945,600
トプコン	40,300	1,647.000	66,374,100
オリンパス	475,400	2,806.000	1,333,972,400
理研計器	4,800	5,000.000	24,000,000
タムロン	5,700	3,465.000	19,750,500
H O Y A	164,300	14,060.000	2,310,058,000
ノーリツ鋼機	7,300	2,634.000	19,228,200
A & Dホロンホールディングス	11,100	1,043.000	11,577,300
朝日インテック	100,500	2,414.000	242,607,000
シチズン時計	83,700	600.000	50,220,000

リズム	3,000	1,764.000	5,292,000
メニコン	26,200	2,905.000	76,111,000
松 風	3,700	2,430.000	8,991,000
セイコーグループ	11,800	3,165.000	37,347,000
ニプロ	64,500	1,017.000	65,596,500
スノーピーク	13,300	2,265.000	30,124,500
パラマウントベッドHD	17,300	2,681.000	46,381,300
トランザクション	6,600	1,286.000	8,487,600
ニホンフラッシュ	7,800	965.000	7,527,000
前田工織	8,400	3,245.000	27,258,000
永大産業	27,200	226.000	6,147,200
アートネイチャー	8,900	777.000	6,915,300
バンダイナムコHLDGS	69,400	9,045.000	627,723,000
SHOEI	8,000	5,540.000	44,320,000
フランスベッドHLDGS	10,600	932.000	9,879,200
パイロットコーポレーション	11,900	4,950.000	58,905,000
萩原工業	6,500	1,063.000	6,909,500
フジシールインターナショナル	15,500	1,869.000	28,969,500
タカラトミー	35,300	1,256.000	44,336,800
広済堂ホールディングス	5,500	1,945.000	10,697,500
プロネクサス	7,500	966.000	7,245,000
ウッドワン	5,000	932.000	4,660,000
大建工業	5,000	2,138.000	10,690,000
凸版印刷	98,900	2,132.000	210,854,800
大日本印刷	89,800	2,841.000	255,121,800
共同印刷	2,700	2,904.000	7,840,800
N I S S H A	14,600	1,759.000	25,681,400
T A K A R A & C O M P A N Y	5,800	2,089.000	12,116,200
アシックス	70,300	2,955.000	207,736,500
ローランド	5,700	4,060.000	23,142,000
小松ウオール工業	3,000	1,840.000	5,520,000
ヤマハ	47,800	5,410.000	258,598,000
河合楽器	2,200	2,579.000	5,673,800
クリナップ	9,700	670.000	6,499,000
ビジョン	49,000	2,044.000	100,156,000
キングジム	7,900	894.000	7,062,600
リンテック	15,200	2,248.000	34,169,600
イトーキ	18,100	535.000	9,683,500
任 天 堂	480,200	5,894.000	2,830,298,800
三菱鉛筆	10,900	1,394.000	15,194,600
タカラスタンダード	14,200	1,324.000	18,800,800
コ ク ヨ	36,500	1,807.000	65,955,500
ナカバヤシ	3,300	501.000	1,653,300
グローブライド	6,200	2,678.000	16,603,600
オカムラ	22,500	1,415.000	31,837,500
美 津 濃	7,600	2,869.000	21,804,400
東京電力HD	686,300	499.000	342,463,700
中部電力	278,900	1,288.000	359,223,200

関西電力	292,300	1,166.000	340,821,800
中国電力	121,900	715.000	87,158,500
北陸電力	73,700	537.000	39,576,900
東北電力	186,200	653.000	121,588,600
四国電力	65,800	753.000	49,547,400
九州電力	174,300	718.000	125,147,400
北海道電力	75,200	454.000	34,140,800
沖縄電力	19,100	1,054.000	20,131,400
電源開発	57,500	2,118.000	121,785,000
エフオン	6,800	548.000	3,726,400
イーレックス	13,500	2,522.000	34,047,000
レノバ	20,300	2,731.000	55,439,300
東京瓦斯	160,600	2,526.000	405,675,600
大阪瓦斯	153,600	2,122.000	325,939,200
東邦瓦斯	30,000	2,691.000	80,730,000
北海道瓦斯	5,000	1,692.000	8,460,000
広島ガス	13,700	340.000	4,658,000
西部ガスHLDGS	7,100	1,678.000	11,913,800
静岡ガス	17,000	1,100.000	18,700,000
メタウォーター	9,400	1,789.000	16,816,600
SBSホールディングス	6,600	2,965.000	19,569,000
東武鉄道	83,100	3,310.000	275,061,000
相鉄ホールディングス	25,400	2,190.000	55,626,000
東急	212,200	1,749.000	371,137,800
京浜急行	86,600	1,440.000	124,704,000
小田急電鉄	115,000	1,802.000	207,230,000
京王電鉄	40,200	5,120.000	205,824,000
京成電鉄	48,900	3,915.000	191,443,500
富士急行	9,400	4,920.000	46,248,000
東日本旅客鉄道	129,100	7,811.000	1,008,400,100
西日本旅客鉄道	97,500	5,836.000	569,010,000
東海旅客鉄道	58,700	16,630.000	976,181,000
西武ホールディングス	92,400	1,380.000	127,512,000
鴻池運輸	13,100	1,581.000	20,711,100
西日本鉄道	20,200	2,806.000	56,681,200
ハマキョウレックス	5,900	3,425.000	20,207,500
サカイ引越センター	3,700	4,595.000	17,001,500
近鉄グループHLDGS	75,700	4,900.000	370,930,000
阪急阪神HLDGS	100,700	4,290.000	432,003,000
南海電鉄	36,400	3,010.000	109,564,000
京阪ホールディングス	31,400	3,460.000	108,644,000
神戸電鉄	2,800	3,235.000	9,058,000
名古屋鉄道	84,000	2,259.000	189,756,000
山陽電鉄	6,300	2,235.000	14,080,500
アルプス物流	6,000	1,160.000	6,960,000
ヤマトホールディングス	97,200	2,293.000	222,879,600
山九	19,300	4,945.000	95,438,500
丸全昭和運輸	4,700	3,220.000	15,134,000

センコーグループHLDGS	39,800	1,016.000	40,436,800
トナミホールディングス	1,800	3,650.000	6,570,000
ニッコンホールディングス	24,300	2,419.000	58,781,700
福山通運	6,300	3,500.000	22,050,000
セイノーホールディングス	47,000	1,204.000	56,588,000
神奈川中央交通	2,500	3,365.000	8,412,500
日立物流	16,700	8,890.000	148,463,000
AZ-COM丸和ホールディ	18,500	1,460.000	27,010,000
C&Fロジホールディングス	7,800	1,226.000	9,562,800
九州旅客鉄道	54,100	3,025.000	163,652,500
SGホールディングス	145,400	2,130.000	309,702,000
NIPPON EXPRESS	28,100	8,090.000	227,329,000
日本郵船	202,000	3,037.000	613,474,000
商船三井	133,300	3,365.000	448,554,500
川崎汽船	64,700	2,598.000	168,090,600
NSユニテッド海運	4,200	3,780.000	15,876,000
明治海運	9,300	721.000	6,705,300
飯野海運	29,000	933.000	27,057,000
乾汽船	10,600	1,827.000	19,366,200
日本航空	185,800	2,733.000	507,791,400
ANAホールディングス	207,300	2,944.500	610,394,850
パスコ	3,200	1,331.000	4,259,200
トランコム	2,200	7,920.000	17,424,000
日新	6,300	2,034.000	12,814,200
三菱倉庫	16,200	3,340.000	54,108,000
三井倉庫HOLD	7,100	3,535.000	25,098,500
住友倉庫	20,400	2,002.000	40,840,800
渋沢倉庫	3,500	2,078.000	7,273,000
東陽倉庫	27,400	257.000	7,041,800
日本トランスシティ	16,000	501.000	8,016,000
川西倉庫	5,200	1,006.000	5,231,200
東洋埠頭	900	1,283.000	1,154,700
上組	37,400	2,799.000	104,682,600
キューソー流通システム	6,600	1,033.000	6,817,800
エーアイテイー	5,400	1,437.000	7,759,800
内外トランスライン	3,200	2,204.000	7,052,800
日本コンセプト	2,900	1,747.000	5,066,300
NECネットエスアイ	25,300	1,642.000	41,542,600
クロスキャット	4,800	1,599.000	7,675,200
システナ	126,900	420.000	53,298,000
デジタルアーツ	4,900	6,450.000	31,605,000
日鉄ソリューションズ	12,700	3,435.000	43,624,500
キューブシステム	5,700	1,017.000	5,796,900
コア	3,900	1,470.000	5,733,000
手間いらず	1,300	5,150.000	6,695,000
ラクーンホールディングス	8,500	1,260.000	10,710,000
ソリトンシステムズ	5,100	1,165.000	5,941,500
ソフトクリエイティブHD	3,400	3,520.000	11,968,000

T I S	85,400	3,890.000	332,206,000
グリー	41,900	768.000	32,179,200
コーエーテクモHD	47,800	2,375.000	113,525,000
三菱総合研究所	3,700	5,150.000	19,055,000
ファインデックス	8,000	552.000	4,416,000
ブレインパッド	8,200	893.000	7,322,600
K L a b	17,200	490.000	8,428,000
ポルトウウィンホールディング	13,700	937.000	12,836,900
ネクソン	197,100	2,894.000	570,407,400
アイスタイル	25,300	538.000	13,611,400
エムアップホールディングス	9,600	1,354.000	12,998,400
エイチーム	7,000	829.000	5,803,000
エニグモ	11,200	597.000	6,686,400
コロブラ	30,000	686.000	20,580,000
ブロードリーフ	46,400	496.000	23,014,400
クロス・マーケティングG	4,200	783.000	3,288,600
デジタルハーツHLDGS	5,200	1,890.000	9,828,000
システム情報	7,400	898.000	6,645,200
メディアドゥ	3,500	1,910.000	6,685,000
じげん	25,200	357.000	8,996,400
ブイキューブ	10,200	795.000	8,109,000
サイバーリンクス	3,100	1,131.000	3,506,100
ディー・エル・イー	8,600	336.000	2,889,600
フィックスターズ	9,600	1,376.000	13,209,600
CARTA HOLDINGS	4,200	1,700.000	7,140,000
オブティム	7,300	1,162.000	8,482,600
S H I F T	5,600	28,870.000	161,672,000
ティーガイア	8,100	1,652.000	13,381,200
テクマトリックス	14,300	1,646.000	23,537,800
プロシップ	3,900	1,527.000	5,955,300
ガンホー・オンライン・エンター	23,800	2,080.000	49,504,000
GMOペイメントゲートウェイ	17,400	12,160.000	211,584,000
システムリサーチ	2,700	2,031.000	5,483,700
インターネットイニシアティブ	42,400	2,450.000	103,880,000
さくらインターネット	11,100	527.000	5,849,700
ヴィンクス	1,000	1,682.000	1,682,000
GMOグローバルサインHD	2,500	4,000.000	10,000,000
S R Aホールディングス	4,100	3,125.000	12,812,500
朝日ネット	9,400	571.000	5,367,400
e B A S E	12,100	620.000	7,502,000
アバントグループ	9,800	1,500.000	14,700,000
アドソル日進	4,000	1,508.000	6,032,000
フリービット	5,700	1,156.000	6,589,200
コムチュア	10,300	2,607.000	26,852,100
アステリア	7,500	812.000	6,090,000
アイル	4,400	1,991.000	8,760,400
マークラインズ	4,500	2,783.000	12,523,500
メディカル・データ・ビジ	12,200	1,002.000	12,224,400

g u m i	13,300	737.000	9,802,100
テラスカイ	3,600	2,800.000	10,080,000
デジタル・インフォメーション	4,500	1,985.000	8,932,500
ネオジャパン	900	1,001.000	900,900
P R T I M E S	2,200	2,478.000	5,451,600
ラクス	36,200	1,720.000	62,264,000
ダブルスタンダード	3,400	2,213.000	7,524,200
オープンドア	5,700	1,967.000	11,211,900
アカツキ	4,200	2,274.000	9,550,800
U B I C O Mホールディングス	2,800	2,295.000	6,426,000
カナミックネットワーク	12,800	645.000	8,256,000
チェンジ	18,800	2,181.000	41,002,800
シンクロ・フード	6,400	476.000	3,046,400
オークネット	4,300	1,951.000	8,389,300
マクロミル	18,000	1,103.000	19,854,000
オロ	2,900	1,867.000	5,414,300
ユーザーローカル	3,200	1,590.000	5,088,000
マネーフォワード	17,200	4,885.000	84,022,000
電算システムHD	4,000	2,272.000	9,088,000
プロトコーポレーション	10,000	1,260.000	12,600,000
野村総合研究所	156,300	2,996.000	468,274,800
サイバネットシステム	8,400	967.000	8,122,800
日本システム技術	3,900	1,734.000	6,762,600
インテージホールディングス	10,600	1,532.000	16,239,200
ソースネクスト	41,100	279.000	11,466,900
インフォコム	9,900	2,046.000	20,255,400
シンプレクスHD	12,900	2,321.000	29,940,900
HEROZ	3,300	1,247.000	4,115,100
ラクスル	11,000	3,065.000	33,715,000
メルカリ	33,600	2,811.000	94,449,600
I P S	2,700	3,075.000	8,302,500
F I G	11,900	409.000	4,867,100
システムサポート	3,900	1,492.000	5,818,800
イーソル	3,100	911.000	2,824,100
アルテリア・ネットワークス	8,300	1,250.000	10,375,000
ウイングアーク1 S T	8,100	2,219.000	17,973,900
サーバーワークス	1,800	2,807.000	5,052,600
S a n s a n	29,000	1,670.000	48,430,000
ギフトィ	8,500	2,261.000	19,218,500
ベース	2,600	3,865.000	10,049,000
J M D C	12,600	5,120.000	64,512,000
フォーカスシステムズ	7,000	1,002.000	7,014,000
クレスコ	6,300	1,735.000	10,930,500
フジ・メディア・HD	73,600	1,077.000	79,267,200
オービック	25,400	21,700.000	551,180,000
ジャストシステム	11,200	3,300.000	36,960,000
T D Cソフト	6,700	1,469.000	9,842,300
Zホールディングス	1,087,200	373.500	406,069,200

トレンドマイクロ	44,100	6,810.000	300,321,000
日本オラクル	14,800	8,030.000	118,844,000
アルファシステムズ	2,400	4,240.000	10,176,000
フューチャー	18,900	1,671.000	31,581,900
C A C H O L D I N G S	4,900	1,532.000	7,506,800
S B テク ノ ロ ジ ー	3,600	2,060.000	7,416,000
オービックビジネスC	15,000	4,675.000	70,125,000
伊藤忠テクノソリュー	40,800	3,350.000	136,680,000
アイティフォー	11,300	801.000	9,051,300
東計電算	1,400	5,910.000	8,274,000
大塚商会	43,300	4,570.000	197,881,000
サイボウズ	10,800	2,219.000	23,965,200
電通国際情報S	9,100	4,575.000	41,632,500
A C C E S S	10,300	748.000	7,704,400
デジタルガレージ	13,600	4,005.000	54,468,000
イーエムシステムズ	13,500	988.000	13,338,000
ウェザーニューズ	2,800	7,610.000	21,308,000
C I J	7,800	934.000	7,285,200
ビジネスエンジニアリング	2,000	2,219.000	4,438,000
WOWOW	5,800	1,252.000	7,261,600
スカラ	10,000	747.000	7,470,000
インテリジェント ウェイブ	5,300	806.000	4,271,800
I M A G I C A G R O U P	7,000	755.000	5,285,000
ネットワンシステムズ	28,600	3,400.000	97,240,000
アルゴグラフィックス	7,000	3,800.000	26,600,000
マーベラス	13,600	679.000	9,234,400
エイベックス	13,500	1,529.000	20,641,500
B I P R O G Y	28,200	3,285.000	92,637,000
兼松エレクトロニクス	4,800	4,565.000	21,912,000
都築電気	4,600	1,334.000	6,136,400
T B S ホールディングス	39,100	1,568.000	61,308,800
日本テレビH L D S	67,600	1,059.000	71,588,400
朝日放送グループHD	2,600	622.000	1,617,200
テレビ朝日HD	18,800	1,371.000	25,774,800
スカパーJ S A T H D	68,600	508.000	34,848,800
テレビ東京HD	6,000	1,841.000	11,046,000
ビジョン	10,500	1,377.000	14,458,500
U S E N - N E X T H L D G S	7,000	2,351.000	16,457,000
コネクシオ	5,300	1,199.000	6,354,700
日本通信	75,200	222.000	16,694,400
日本電信電話	977,200	3,820.000	3,732,904,000
K D D I	589,400	4,111.000	2,423,023,400
ソフトバンク	1,225,300	1,497.500	1,834,886,750
光通信	9,000	19,170.000	172,530,000
エムティーアイ	9,100	506.000	4,604,600
G M O インターネットグループ	28,500	2,535.000	72,247,500
ファイバーゲート	5,300	940.000	4,982,000
K A D O K A W A	40,500	2,543.000	102,991,500

学研ホールディングス	13,800	1,026.000	14,158,800
ゼンリン	13,600	861.000	11,709,600
アイネット	5,800	1,305.000	7,569,000
松竹	4,500	11,900.000	53,550,000
東宝	47,600	5,290.000	251,804,000
東映	2,100	18,910.000	39,711,000
NTTデータ	238,500	2,102.000	501,327,000
ピー・シー・エー	5,300	1,282.000	6,794,600
ビジネスB太田昭和	4,000	1,951.000	7,804,000
DTS	16,300	3,295.000	53,708,500
スクウェア・エニックス・HD	38,400	6,190.000	237,696,000
シーイーシー	11,100	1,513.000	16,794,300
カプコン	75,700	4,175.000	316,047,500
アイ・エス・ピー	4,500	1,308.000	5,886,000
ジャステック	5,600	1,198.000	6,708,800
SCSK	61,900	2,202.000	136,303,800
NSW	3,300	2,170.000	7,161,000
アイネス	6,000	1,444.000	8,664,000
TKC	13,200	3,735.000	49,302,000
富士ソフト	8,500	8,140.000	69,190,000
NSD	26,700	2,560.000	68,352,000
コナミグループ	32,700	6,450.000	210,915,000
福井コンピュータHLD S	5,400	2,944.000	15,897,600
JBC Cホールディングス	5,900	1,959.000	11,558,100
ミロク情報サービス	7,600	1,501.000	11,407,600
ソフトバンクグループ	441,100	5,952.000	2,625,427,200
高千穂交易	3,300	2,190.000	7,227,000
伊藤忠食品	1,800	5,190.000	9,342,000
エレマテック	7,400	1,536.000	11,366,400
あらた	6,200	4,025.000	24,955,000
トーメンデバイス	1,300	5,570.000	7,241,000
東京エレクトロンデバイス	3,000	6,870.000	20,610,000
円谷フィールズホールディ	7,200	2,372.000	17,078,400
双日	85,300	2,438.000	207,961,400
アルフレッサホールディングス	81,100	1,666.000	135,112,600
横浜冷凍	24,100	995.000	23,979,500
ラサ商事	5,800	1,009.000	5,852,200
アルコニックス	11,400	1,315.000	14,991,000
神戸物産	62,200	3,575.000	222,365,000
あいホールディングス	12,800	2,220.000	28,416,000
ダイワボウHD	32,900	2,176.000	71,590,400
マクニカホールディングス	19,500	3,445.000	67,177,500
ラクト・ジャパン	3,600	2,121.000	7,635,600
グリムス	3,500	1,815.000	6,352,500
バイタルKSKHD	13,400	826.000	11,068,400
八洲電機	7,800	1,015.000	7,917,000
メディアスホールディングス	6,800	765.000	5,202,000
レスターホールディングス	7,600	2,219.000	16,864,400

ジューテックHD	4,700	1,153.000	5,419,100
TOKAIホールディングス	39,500	876.000	34,602,000
三洋貿易	8,900	1,139.000	10,137,100
ビューティガレージ	1,800	3,015.000	5,427,000
ウイン・パートナーズ	5,600	992.000	5,555,200
シップヘルスケアHD	29,100	2,773.000	80,694,300
コメダホールディングス	20,300	2,412.000	48,963,600
フルサト・マルカHD	8,000	3,970.000	31,760,000
ヤマエグループHD	5,000	1,433.000	7,165,000
小野建	8,200	1,444.000	11,840,800
佐島電機	6,100	1,348.000	8,222,800
伯東	4,700	3,735.000	17,554,500
コンドーテック	7,300	1,004.000	7,329,200
ナガイレーベン	10,500	2,007.000	21,073,500
三菱食品	8,300	3,250.000	26,975,000
松田産業	6,200	2,303.000	14,278,600
第一興商	15,700	4,090.000	64,213,000
メディバルHD	83,600	1,830.000	152,988,000
S P K	4,800	1,391.000	6,676,800
萩原電気HLDGS	3,700	2,517.000	9,312,900
アズワン	11,800	6,110.000	72,098,000
スズデン	3,800	2,293.000	8,713,400
尾家産業	4,700	926.000	4,352,200
シモジマ	6,200	961.000	5,958,200
ドウシシャ	8,500	1,524.000	12,954,000
高速	4,400	1,768.000	7,779,200
リックス	2,000	2,206.000	4,412,000
丸文	8,600	910.000	7,826,000
ハピネット	7,200	1,941.000	13,975,200
日本ライフライン	24,300	947.000	23,012,100
タカショー	9,100	704.000	6,406,400
IDOM	25,100	748.000	18,774,800
進和	5,800	2,058.000	11,936,400
ダイترون	3,600	2,446.000	8,805,600
シークス	11,700	1,399.000	16,368,300
オーハシテクニカ	4,900	1,399.000	6,855,100
白銅	3,200	2,493.000	7,977,600
伊藤忠	495,400	4,287.000	2,123,779,800
丸紅	633,000	1,548.000	979,884,000
高島	1,000	2,970.000	2,970,000
長瀬産業	37,200	2,019.000	75,106,800
蝶理	4,400	1,987.000	8,742,800
豊田通商	70,000	5,230.000	366,100,000
三共生興	17,300	483.000	8,355,900
兼松	30,700	1,528.000	46,909,600
三井物産	588,600	3,983.000	2,344,393,800
日本紙パルプ	4,300	5,030.000	21,629,000
カメイ	8,900	1,201.000	10,688,900

スターゼン	6,400	2,077.000	13,292,800
山 善	21,400	1,000.000	21,400,000
椿本興業	1,500	3,995.000	5,992,500
住友商事	497,600	2,247.000	1,118,107,200
内田洋行	3,700	4,640.000	17,168,000
三菱商事	502,500	4,605.000	2,314,012,500
第一実業	3,100	4,240.000	13,144,000
キヤノンマーケティングJ P N	18,600	3,110.000	57,846,000
西華産業	4,100	1,551.000	6,359,100
佐藤商事	6,100	1,196.000	7,295,600
菱洋エレクトロ	7,400	2,348.000	17,375,200
東京産業	8,400	790.000	6,636,000
ユアサ商事	7,100	3,590.000	25,489,000
神鋼商事	2,200	4,520.000	9,944,000
阪和興業	14,300	3,580.000	51,194,000
正栄食品	5,500	4,275.000	23,512,500
カナデン	7,300	1,103.000	8,051,900
菱電商事	6,700	1,686.000	11,296,200
岩谷産業	18,400	5,770.000	106,168,000
ナイス	3,400	1,318.000	4,481,200
極東貿易	6,000	1,325.000	7,950,000
アステナホールディングス	17,800	417.000	7,422,600
三愛オブリ	22,300	1,292.000	28,811,600
稲畑産業	16,300	2,369.000	38,614,700
G S Iクレオス	5,600	1,458.000	8,164,800
明和産業	11,600	701.000	8,131,600
ワ キ タ	15,500	1,198.000	18,569,000
東邦ホールディングス	20,800	2,130.000	44,304,000
サンゲツ	20,500	2,101.000	43,070,500
ミツウロコグループ	11,800	1,058.000	12,484,400
シナネンホールディングス	2,700	3,800.000	10,260,000
伊藤忠エネクス	19,300	1,020.000	19,686,000
サンリオ	23,000	4,525.000	104,075,000
サンワ テクノス	4,800	1,526.000	7,324,800
リョーサン	8,800	2,842.000	25,009,600
新光商事	12,100	1,125.000	13,612,500
トーホー	4,200	1,731.000	7,270,200
三信電気	3,700	2,246.000	8,310,200
東陽テクニカ	9,500	1,399.000	13,290,500
モスフード サービス	12,000	3,180.000	38,160,000
加賀電子	6,600	4,390.000	28,974,000
立花エレクトック	6,000	1,776.000	10,656,000
P A L T A C	12,700	4,315.000	54,800,500
三谷産業	19,100	313.000	5,978,300
太平洋興発	9,500	748.000	7,106,000
西本W I S M E T T A C H D	2,200	3,700.000	8,140,000
コア商事H L D G S	6,600	621.000	4,098,600
K P Pグループホールディン	19,300	972.000	18,759,600

ヤマタネ	5,000	1,696.000	8,480,000
日鉄物産	5,200	5,100.000	26,520,000
泉州電業	3,800	2,788.000	10,594,400
トラスコ中山	16,800	2,087.000	35,061,600
オートバックスセブン	29,000	1,458.000	42,282,000
モリト	7,800	758.000	5,912,400
加藤産業	9,500	3,495.000	33,202,500
イエローハット	14,100	1,724.000	24,308,400
J Kホールディングス	6,800	1,042.000	7,085,600
日 伝	5,000	1,700.000	8,500,000
杉本商事	3,800	2,062.000	7,835,600
因幡電機産業	20,200	2,782.000	56,196,400
東 テ ク	2,800	3,275.000	9,170,000
ミスミグループ本社	121,300	3,350.000	406,355,000
タキヒヨー	6,600	900.000	5,940,000
スズケン	25,000	3,695.000	92,375,000
ジェコス	2,000	803.000	1,606,000
ローソン	20,200	4,925.000	99,485,000
サンエー	6,000	4,360.000	26,160,000
カワチ薬品	6,600	2,111.000	13,932,600
エービーシー・マート	11,700	6,970.000	81,549,000
ハードオフコーポレーション	4,200	1,424.000	5,980,800
アスクル	19,700	1,581.000	31,145,700
ゲオホールディングス	8,800	1,961.000	17,256,800
アダストリア	10,000	2,007.000	20,070,000
くら寿司	9,600	3,350.000	32,160,000
キャンドウ	4,500	2,153.000	9,688,500
パルグループHLDGS	8,200	2,421.000	19,852,200
エディオン	31,500	1,254.000	39,501,000
サーラコーポレーション	17,900	750.000	13,425,000
ハローズ	3,700	2,994.000	11,077,800
フジオフードG本社	7,500	1,388.000	10,410,000
ひらまつ	26,400	186.000	4,910,400
大黒天物産	3,000	5,280.000	15,840,000
ハニーズホールディングス	7,800	1,228.000	9,578,400
アルペン	6,800	2,030.000	13,804,000
クオールホールディングス	11,700	1,140.000	13,338,000
ジンズホールディングス	5,000	4,325.000	21,625,000
ビックカメラ	53,500	1,265.000	67,677,500
DCMホールディングス	49,300	1,148.000	56,596,400
Monotaro	113,900	2,336.000	266,070,400
アークランドサービスHD	6,900	2,222.000	15,331,800
J . フロント リテイリング	100,600	1,159.000	116,595,400
ドトール・日レスHD	14,300	1,691.000	24,181,300
マツキヨココカラ&カンパニー	48,800	5,720.000	279,136,000
ブロンコビリー	5,000	2,500.000	12,500,000
ZOZO	53,300	3,425.000	182,552,500
トレジャー・ファクトリー	2,600	2,396.000	6,229,600

物語コーポレーション	4,500	7,020.000	31,590,000
三越伊勢丹HD	135,700	1,324.000	179,666,800
Hamee	4,300	881.000	3,788,300
ウエルシアHD	41,800	3,020.000	126,236,000
クリエイトSDH	13,000	3,065.000	39,845,000
チムニー	7,500	1,127.000	8,452,500
シュッピン	6,500	1,470.000	9,555,000
オイシックス・ラ・大地	11,000	1,927.000	21,197,000
ネクステージ	18,400	3,085.000	56,764,000
ジョイフル本田	25,600	1,849.000	47,334,400
鳥貴族ホールディングス	3,700	2,445.000	9,046,500
ホットランド	7,400	1,527.000	11,299,800
すかいらくHD	110,600	1,596.000	176,517,600
SFPホールディングス	5,000	1,711.000	8,555,000
綿半ホールディングス	6,800	1,357.000	9,227,600
ユナイテッド・スーパーマーケ	27,800	1,101.000	30,607,800
ゴルフダイジェスト・オン	4,200	1,741.000	7,312,200
BEENOS	4,700	3,180.000	14,946,000
あさひ	6,800	1,332.000	9,057,600
日本調剤	6,100	1,198.000	7,307,800
コスモス薬品	9,100	13,960.000	127,036,000
セブン&アイ・HLDG S	277,300	5,579.000	1,547,056,700
クリエイト・レストランツ・ホール	61,100	939.000	57,372,900
ツルハホールディングス	19,800	8,870.000	175,626,000
サンマルクホールディングス	7,300	1,690.000	12,337,000
フェリシモ	5,000	1,027.000	5,135,000
トリドールホールディングス	20,100	2,692.000	54,109,200
JMホールディングス	7,200	1,759.000	12,664,800
アレンザホールディングス	6,600	984.000	6,494,400
串カツ田中HLDG S	3,600	1,803.000	6,490,800
パロックジャパン	1,400	799.000	1,118,600
クスリのアオキHLDG S	8,100	7,580.000	61,398,000
力の源HD	6,200	909.000	5,635,800
FOOD&LIFE COMPAN	46,400	2,495.000	115,768,000
メディカルシステムネットワーク	5,300	404.000	2,141,200
ノジマ	26,200	1,395.000	36,549,000
カップ・クリエイト	13,500	1,378.000	18,603,000
ライトオン	9,200	636.000	5,851,200
良品計画	104,100	1,449.000	150,840,900
アドヴァングループ	11,000	890.000	9,790,000
アルビス	3,100	2,384.000	7,390,400
G-7ホールディングス	9,900	1,523.000	15,077,700
イオン北海道	13,200	1,178.000	15,549,600
コジマ	16,200	614.000	9,946,800
コーナン商事	10,900	3,310.000	36,079,000
エコス	3,700	1,833.000	6,782,100
ワタミ	11,000	1,059.000	11,649,000
パンパシフィックHD	180,400	2,384.000	430,073,600

西松屋チェーン	18,100	1,395.000	25,249,500
ゼンショーホールディングス	43,900	3,465.000	152,113,500
幸楽苑ホールディングス	6,800	1,030.000	7,004,000
サイゼリヤ	13,700	2,813.000	38,538,100
V Tホールディングス	31,100	508.000	15,798,800
フジ・コーポレーション	5,100	1,288.000	6,568,800
ユナイテッドアローズ	9,000	1,885.000	16,965,000
ハイデイ日高	12,100	1,958.000	23,691,800
コロワイド	37,700	1,789.000	67,445,300
壱番屋	6,300	4,555.000	28,696,500
スギホールディングス	16,300	6,190.000	100,897,000
薬王堂ホールディングス	4,600	2,580.000	11,868,000
スクロール	12,800	711.000	9,100,800
ヨンドシーホールディングス	7,600	1,732.000	13,163,200
木曽路	12,900	2,142.000	27,631,800
S R Sホールディングス	16,000	847.000	13,552,000
千趣会	17,100	409.000	6,993,900
リテールパートナーズ	12,000	1,237.000	14,844,000
ケーヨー	13,900	903.000	12,551,700
上新電機	7,100	1,905.000	13,525,500
日本瓦斯	43,300	2,103.000	91,059,900
ロイヤルホールディングス	15,800	2,397.000	37,872,600
いなげや	8,100	1,184.000	9,590,400
チヨダ	10,200	763.000	7,782,600
ライフコーポレーション	7,100	2,457.000	17,444,700
リンガーハット	11,300	2,195.000	24,803,500
MrMaxHD	12,200	662.000	8,076,400
AOKIホールディングス	15,900	686.000	10,907,400
オークワ	13,500	942.000	12,717,000
コメリ	12,300	2,590.000	31,857,000
青山商事	18,200	999.000	18,181,800
しまむら	9,400	12,490.000	117,406,000
高島屋	61,300	1,786.000	109,481,800
松屋	14,400	975.000	14,040,000
エイチ・ツー・オーリテイリング	39,500	1,220.000	48,190,000
近鉄百貨店	4,000	2,465.000	9,860,000
丸井グループ	59,300	2,334.000	138,406,200
アクシアルリテイリング	5,400	3,395.000	18,333,000
イオン	272,800	2,823.000	770,114,400
イズミ	12,400	3,015.000	37,386,000
平和堂	13,200	2,031.000	26,809,200
フジ	12,500	1,868.000	23,350,000
ヤオコー	9,100	6,700.000	60,970,000
ゼビオホールディングス	11,300	942.000	10,644,600
ケーズホールディングス	64,300	1,140.000	73,302,000
OLYMPICグループ	8,000	524.000	4,192,000
シルバーライフ	2,500	1,557.000	3,892,500
GENKY DRUGSTORES	4,100	3,460.000	14,186,000

ブックオフGHD	5,200	1,314.000	6,832,800
ギフトホールディングス	1,900	3,950.000	7,505,000
アインホールディングス	11,200	6,730.000	75,376,000
元気寿司	3,300	3,180.000	10,494,000
ヤマダホールディングス	331,000	477.000	157,887,000
アークランズ	12,300	1,498.000	18,425,400
ニトリホールディングス	32,600	15,565.000	507,419,000
グルメ杵屋	8,700	997.000	8,673,900
ケーユーホールディングス	3,300	1,300.000	4,290,000
吉野家ホールディングス	32,000	2,321.000	74,272,000
松屋フーズHLDGS	3,800	3,995.000	15,181,000
サガミホールディングス	14,200	1,221.000	17,338,200
関西フードマーケット	8,100	1,389.000	11,250,900
王将フードサービス	5,100	6,060.000	30,906,000
ミニストップ	7,000	1,423.000	9,961,000
アークス	14,200	2,099.000	29,805,800
パローホールディングス	15,100	1,758.000	26,545,800
ベルク	3,900	5,720.000	22,308,000
大庄	7,800	1,061.000	8,275,800
ファーストリテイリング	12,100	80,810.000	977,801,000
サンドラッグ	30,600	3,660.000	111,996,000
サックスパーホールディング	9,400	800.000	7,520,000
やまや	3,500	2,476.000	8,666,000
ベルーナ	19,700	689.000	13,573,300
いよぎんホールディング	88,100	729.000	64,224,900
しずおかフィナンシャル	168,000	1,005.000	168,840,000
ちゅうぎんフィナンシャル	62,300	968.000	60,306,400
めぶきフィナンシャルG	372,000	312.000	116,064,000
東京きらぼしFG	9,700	2,387.000	23,153,900
九州フィナンシャルG	126,700	397.000	50,299,900
ゆうちょ銀行	212,400	1,051.000	223,232,400
富山第一銀行	21,100	568.000	11,984,800
コンコルディア・フィナンシャル	410,500	477.000	195,808,500
西日本フィナンシャルHD	47,600	874.000	41,602,400
33FG	7,400	1,500.000	11,100,000
第四北越フィナンシャルG	11,100	2,618.000	29,059,800
ひろぎんHLDGS	97,800	632.000	61,809,600
おきなわFG	7,600	2,144.000	16,294,400
十六FG	10,000	2,640.000	26,400,000
北國FHD	6,400	4,455.000	28,512,000
プロクレアホールディングス	9,700	2,159.000	20,942,300
あいちフィナンシャル	10,400	2,215.000	23,036,000
新生銀行	22,700	2,339.000	53,095,300
あおぞら銀行	46,700	2,595.000	121,186,500
三菱UFJフィナンシャルG	4,906,500	755.100	3,704,898,150
りそなホールディングス	953,500	660.900	630,168,150
三井住友トラストHD	138,100	4,407.000	608,606,700
三井住友フィナンシャルG	546,500	4,673.000	2,553,794,500

千葉銀行	207,600	834.000	173,138,400
群馬銀行	144,500	451.000	65,169,500
武蔵野銀行	9,900	1,883.000	18,641,700
千葉興業銀行	22,000	376.000	8,272,000
筑波銀行	41,100	212.000	8,713,200
七十七銀行	24,100	1,948.000	46,946,800
秋田銀行	5,900	1,684.000	9,935,600
山形銀行	10,000	1,217.000	12,170,000
岩手銀行	6,000	1,935.000	11,610,000
東邦銀行	67,900	210.000	14,259,000
ふくおかフィナンシャルG	59,600	2,691.000	160,383,600
スルガ銀行	67,700	429.000	29,043,300
八十二銀行	150,800	519.000	78,265,200
山梨中央銀行	9,400	1,043.000	9,804,200
大垣共立銀行	14,500	1,844.000	26,738,000
福井銀行	8,100	1,464.000	11,858,400
清水銀行	1,500	1,529.000	2,293,500
富山銀行	3,400	1,746.000	5,936,400
滋賀銀行	12,400	2,616.000	32,438,400
南都銀行	11,500	2,335.000	26,852,500
百五銀行	72,400	350.000	25,340,000
京都銀行	23,500	5,700.000	133,950,000
紀陽銀行	26,400	1,521.000	40,154,400
ほくほくフィナンシャルG	48,600	929.000	45,149,400
山陰合同銀行	47,000	755.000	35,485,000
百十四銀行	8,100	1,794.000	14,531,400
四国銀行	14,400	919.000	13,233,600
阿波銀行	11,100	2,042.000	22,666,200
大分銀行	5,800	1,980.000	11,484,000
宮崎銀行	5,800	2,318.000	13,444,400
佐賀銀行	5,400	1,610.000	8,694,000
琉球銀行	21,000	835.000	17,535,000
セブン銀行	268,200	261.000	70,000,200
みずほフィナンシャルG	1,081,300	1,717.000	1,856,592,100
山口フィナンシャルG	83,200	816.000	67,891,200
長野銀行	3,300	1,248.000	4,118,400
名古屋銀行	5,100	3,215.000	16,396,500
北洋銀行	117,900	245.000	28,885,500
愛媛銀行	12,000	881.000	10,572,000
京葉銀行	38,400	545.000	20,928,000
栃木銀行	38,200	321.000	12,262,200
東和銀行	16,600	547.000	9,080,200
トモニホールディングス	64,900	349.000	22,650,100
フィデアホール	9,500	1,361.000	12,929,500
池田泉州HD	106,300	232.000	24,661,600
F P G	31,200	1,165.000	36,348,000
ジャパンインベストメントA	6,700	1,227.000	8,220,900
S B Iホールディングス	107,900	2,618.000	282,482,200

ジャフコ グループ	25,400	2,407.000	61,137,800
大和証券G本社	529,900	608.000	322,179,200
野村ホールディングス	1,374,400	500.700	688,162,080
岡三証券グループ	66,100	387.000	25,580,700
丸三証券	29,900	422.000	12,617,800
東洋証券	29,100	283.000	8,235,300
東海東京HD	81,200	357.000	28,988,400
水戸証券	23,700	226.000	5,356,200
いちよし証券	17,000	612.000	10,404,000
松井証券	44,700	786.000	35,134,200
マネックスG	84,300	430.000	36,249,000
極東証券	12,900	616.000	7,946,400
岩井コスモホールディング	10,000	1,274.000	12,740,000
アイザワ証券グループ	11,900	687.000	8,175,300
スパークス・グループ	8,700	1,707.000	14,850,900
かんぽ生命保険	91,200	2,287.000	208,574,400
S O M P Oホールディングス	128,300	6,059.000	777,369,700
アニコム ホールディングス	29,000	725.000	21,025,000
M S & A D	168,400	4,100.000	690,440,000
第一生命H L D G S	381,200	2,543.500	969,582,200
東京海上HD	753,500	2,827.000	2,130,144,500
T & Dホールディングス	201,200	1,668.000	335,601,600
アドバンスクリエイト	7,400	1,072.000	7,932,800
全国保証	19,700	5,100.000	100,470,000
ジェイリース	2,800	3,105.000	8,694,000
日本モーゲージサービス	7,600	860.000	6,536,000
アルヒ	16,200	1,007.000	16,313,400
プレミアグループ	12,900	1,925.000	24,832,500
ネットプロHD	26,000	476.000	12,376,000
クレディセゾン	47,800	1,757.000	83,984,600
芙蓉総合リース	6,800	8,790.000	59,772,000
みずほリース	10,900	3,305.000	36,024,500
東京センチュリー	13,800	4,720.000	65,136,000
日本証券金融	31,400	1,026.000	32,216,400
アイフル	126,300	408.000	51,530,400
リコーリース	7,300	3,650.000	26,645,000
イオンフィナンシャルサービス	42,600	1,469.000	62,579,400
アコム	140,900	321.000	45,228,900
ジャックス	8,000	3,905.000	31,240,000
オリコ	19,800	1,197.000	23,700,600
オリックス	499,800	2,210.500	1,104,807,900
三菱HCキャピタル	287,400	654.000	187,959,600
日本取引所グループ	210,600	1,975.500	416,040,300
イー・ギャランティ	12,500	2,459.000	30,737,500
NECキャピタルソリューション	4,000	2,080.000	8,320,000
大東建託	27,500	15,320.000	421,300,000
いちご	89,000	309.000	27,501,000
日本駐車場開発	95,800	246.000	23,566,800

スター・マイカ・HLDGS	9,000	716.000	6,444,000
SREホールディングス	3,900	4,575.000	17,842,500
ヒューリック	175,000	1,153.000	201,775,000
三栄建築設計	4,700	1,538.000	7,228,600
野村不動産HLDGS	46,800	3,320.000	155,376,000
三重交通グループHD	18,900	492.000	9,298,800
サムティ	10,100	2,274.000	22,967,400
ディア・ライフ	13,500	623.000	8,410,500
地主	7,300	2,036.000	14,862,800
プレサンスコーポレーション	11,400	1,589.000	18,114,600
JPMC	5,800	1,046.000	6,066,800
フージャースHD	13,700	797.000	10,918,900
オープンハウスグループ	27,400	5,780.000	158,372,000
東急不動産HD	225,500	742.000	167,321,000
飯田GHD	65,600	2,193.000	143,860,800
AND DOホールディングス	5,800	853.000	4,947,400
シーアールイー	4,200	1,491.000	6,262,200
ケイアイスター不動産	4,400	4,930.000	21,692,000
グッドコムアセット	8,400	755.000	6,342,000
ジェイ・エス・ビー	2,100	4,365.000	9,166,500
ロードスターキャピタル	3,700	1,740.000	6,438,000
パーク24	58,800	2,005.000	117,894,000
パラカ	4,400	1,908.000	8,395,200
宮越ホールディングス	800	884.000	707,200
三井不動産	325,800	2,776.500	904,583,700
三菱地所	475,700	1,940.000	922,858,000
平和不動産	13,000	4,090.000	53,170,000
東京建物	71,600	1,921.000	137,543,600
京阪神ビルディング	11,000	1,282.000	14,102,000
住友不動産	135,800	3,716.000	504,632,800
テーオーシー	16,800	727.000	12,213,600
東京楽天地	1,900	4,355.000	8,274,500
スターツコーポレーション	11,400	2,748.000	31,327,200
フジ住宅	13,700	656.000	8,987,200
空港施設	12,600	539.000	6,791,400
明和地所	9,300	631.000	5,868,300
ゴールドクレスト	8,100	1,764.000	14,288,400
エスリード	4,500	1,888.000	8,496,000
日神グループHLDGS	17,100	430.000	7,353,000
日本エスコン	19,500	838.000	16,341,000
MIRARTHホールディング	43,000	390.000	16,770,000
イオンモール	39,500	1,655.000	65,372,500
カチタス	20,600	3,165.000	65,199,000
トーセイ	13,500	1,402.000	18,927,000
サンフロンティア不動産	13,500	1,172.000	15,822,000
FJネクストホールディングス	9,200	966.000	8,887,200
グランディハウス	4,100	548.000	2,246,800
日本空港ビルデング	26,700	6,220.000	166,074,000

日本工営	5,800	3,525.000	20,445,000
L I F U L L	34,300	249.000	8,540,700
M I X I	18,000	2,464.000	44,352,000
ジェイエイシーリクルートメント	7,100	2,587.000	18,367,700
日本M & Aセンターホールデ メンバーズ	134,600	1,840.000	247,664,000
UTグループ	2,600	2,266.000	5,891,600
アイティメディア	11,600	2,695.000	31,262,000
E・Jホールディングス	3,300	1,862.000	6,144,600
夢真ビーネックスグループ	5,700	1,305.000	7,438,500
コシダカホールディングス	28,600	1,922.000	54,969,200
パソナグループ	23,800	1,147.000	27,298,600
リンクアンドモチベーション	9,500	2,058.000	19,551,000
エス・エム・エス	23,200	711.000	16,495,200
パーソルホールディングス	30,000	3,610.000	108,300,000
リニカル	87,800	3,150.000	276,570,000
クックパッド	6,400	728.000	4,659,200
学情	36,000	212.000	7,632,000
スタジオアリス	4,100	1,498.000	6,141,800
シミックホールディングス	4,700	2,087.000	9,808,900
総合警備保障	5,100	1,737.000	8,858,700
カカクコム	29,300	3,725.000	109,142,500
アイロムグループ	58,700	2,428.000	142,523,600
セントケア・ホールディング	3,100	2,218.000	6,875,800
ルネサンス	5,800	854.000	4,953,200
ディップ	7,100	901.000	6,397,100
デジタルホールディングス	13,800	4,095.000	56,511,000
新日本科学	6,800	1,187.000	8,071,600
ベネフィット・ワン	8,500	2,763.000	23,485,500
エムスリー	36,600	2,160.000	79,056,000
アウトソーシング	154,600	4,205.000	650,093,000
ウェルネット	47,200	1,008.000	47,577,600
ワールドホールディングス	9,600	642.000	6,163,200
ディー・エヌ・エー	4,000	2,905.000	11,620,000
博報堂D Y H L D G S	33,800	1,850.000	62,530,000
ぐるなび	100,500	1,331.000	133,765,500
タカミヤ	15,000	419.000	6,285,000
ジャパンベストレスキューS	14,000	385.000	5,390,000
ファンコミュニケーションズ	5,900	872.000	5,144,800
ライク	18,400	441.000	8,114,400
エスプール	3,400	2,082.000	7,078,800
WDBホールディングス	22,800	939.000	21,409,200
アドウェイズ	4,200	2,377.000	9,983,400
バリューコマース	11,500	547.000	6,290,500
インフォマート	6,300	2,091.000	13,173,300
J Pホールディングス	82,900	454.000	37,636,600
プレステージ・インター	27,400	278.000	7,617,200
アミューズ	33,800	712.000	24,065,600
	4,900	1,792.000	8,780,800

ドリームインキュベータ	2,800	2,826.000	7,912,800
クイック	6,500	2,083.000	13,539,500
電通グループ	82,200	4,400.000	361,680,000
ぴあ	2,900	3,280.000	9,512,000
イオンファンタジー	3,700	2,923.000	10,815,100
シーティーエス	10,200	835.000	8,517,000
HUグループHD	23,400	2,775.000	64,935,000
アルプス技研	7,100	2,091.000	14,846,100
日本空調サービス	10,300	708.000	7,292,400
オリエンタルランド	82,800	19,720.000	1,632,816,000
ダスキン	17,700	2,953.000	52,268,100
明光ネットワークジャパン	14,300	617.000	8,823,100
ファルコホールディングス	4,500	1,807.000	8,131,500
ラウンドワン	66,300	610.000	40,443,000
リゾートトラスト	31,300	2,435.000	76,215,500
ビー・エム・エル	9,700	3,460.000	33,562,000
りらいあコミュニケーション	13,000	1,027.000	13,351,000
リソー教育	39,900	323.000	12,887,700
早稲田アカデミー	5,600	1,153.000	6,456,800
ユー・エス・エス	80,700	2,296.000	185,287,200
東京個別指導学院	12,100	529.000	6,400,900
サイバーエージェント	187,700	1,229.000	230,683,300
楽天グループ	345,700	653.000	225,742,100
クリーク・アンド・リバー社	4,900	2,058.000	10,084,200
モーニングスター	15,200	470.000	7,144,000
テー・オー・ダブリュー	22,000	297.000	6,534,000
山田コンサルティングG P	4,900	1,144.000	5,605,600
セントラルスポーツ	3,600	2,416.000	8,697,600
フルキャストホールディングス	7,500	3,075.000	23,062,500
エン・ジャパン	14,300	2,448.000	35,006,400
テクノプロ・ホールディング	52,700	3,790.000	199,733,000
アイ・アールジャパンHD	4,400	1,808.000	7,955,200
Keeper 技研	5,700	4,255.000	24,253,500
Gunosy	6,200	669.000	4,147,800
イー・ガーディアン	3,300	2,866.000	9,457,800
ジャパンマテリアル	24,000	2,433.000	58,392,000
ベクトル	13,000	1,281.000	16,653,000
チャームケアコーポレーション	7,300	1,158.000	8,453,400
キャリアリンク	3,300	3,015.000	9,949,500
IBJ	5,600	980.000	5,488,000
アサンテ	5,200	1,601.000	8,325,200
バリューHR	7,500	1,675.000	12,562,500
M&Aキャピタルパートナー	7,400	4,855.000	35,927,000
ライドオンエクスプレスHD	4,200	1,123.000	4,716,600
ERIホールディングス	3,800	1,080.000	4,104,000
シグマクシス・ホールディング	12,300	1,334.000	16,408,200
ウィルグループ	7,000	1,360.000	9,520,000
メドピア	6,500	1,649.000	10,718,500

リクルートホールディングス	578,700	4,329.000	2,505,192,300
エラン	10,500	1,025.000	10,762,500
日本郵政	1,025,700	1,078.000	1,105,704,600
ベルシステム24HLDGS	10,900	1,348.000	14,693,200
鎌倉新書	9,700	840.000	8,148,000
エアトリ	5,400	2,673.000	14,434,200
アトラエ	6,600	1,477.000	9,748,200
ストライク	3,900	4,465.000	17,413,500
ソラスト	22,100	821.000	18,144,100
セラク	3,300	1,239.000	4,088,700
インソース	9,800	3,375.000	33,075,000
ベйкаレントコンサルティング	58,000	4,465.000	258,970,000
ORCHESTRA HLDGS	2,000	2,305.000	4,610,000
アイモバイル	5,000	1,266.000	6,330,000
ジャパンエレベーターSHD	27,700	1,742.000	48,253,400
ウェルビー	6,900	861.000	5,940,900
エル・ティー・エス	1,300	3,495.000	4,543,500
ミダックホールディングス	4,800	3,370.000	16,176,000
キュービーネットHLDGS	5,200	1,493.000	7,763,600
RPAホールディングス	13,600	287.000	3,903,200
マネジメントソリューションズ	4,600	3,825.000	17,595,000
フロンティア・マネジメント	3,400	1,405.000	4,777,000
カーブスホールディングス	24,400	982.000	23,960,800
フォーラムエンジニアリング	700	870.000	609,000
FAST FITNESS JAP	3,200	1,335.000	4,272,000
ダイレクトマーケティングミクス	9,300	1,495.000	13,903,500
LITALICO	6,200	2,338.000	14,495,600
リログループ	44,000	2,263.000	99,572,000
東祥	7,000	1,226.000	8,582,000
ビーウィズ	3,300	1,187.000	3,917,100
TREホールディングス	16,700	1,571.000	26,235,700
人・夢・技術グループ	3,800	2,106.000	8,002,800
エイチ・アイ・エス	20,800	2,015.000	41,912,000
ラックランド	3,300	2,959.000	9,764,700
共立メンテナンス	13,400	6,100.000	81,740,000
イチネンホールディングス	8,900	1,252.000	11,142,800
建設技術研究所	4,200	3,255.000	13,671,000
スペース	7,200	890.000	6,408,000
燦ホールディングス	4,100	1,821.000	7,466,100
東京テアトル	9,000	1,141.000	10,269,000
ナガワ	2,000	7,660.000	15,320,000
東京都競馬	6,800	4,030.000	27,404,000
カナモト	14,600	2,245.000	32,777,000
西尾レントオール	7,300	3,090.000	22,557,000
トランス・コスモス	9,700	3,235.000	31,379,500
乃村工藝社	34,300	1,032.000	35,397,600
藤田観光	4,100	2,980.000	12,218,000
KNT-CTホールディングス	5,700	1,730.000	9,861,000

日本管財	7,900	2,542.000	20,081,800
トーカイ	7,200	1,869.000	13,456,800
セコム	79,600	8,485.000	675,406,000
セントラル警備保障	4,600	2,439.000	11,219,400
丹青社	16,100	798.000	12,847,800
メイテック	31,600	2,548.000	80,516,800
応用地質	7,700	2,096.000	16,139,200
船井総研ホールディング	16,500	2,795.000	46,117,500
学 究 社	4,900	1,786.000	8,751,400
ベネッセホールディングス	29,900	1,991.000	59,530,900
イオンディライト	8,600	2,925.000	25,155,000
ダイセキ	16,000	4,700.000	75,200,000
ステップ	3,600	1,795.000	6,462,000
合 計	88,126,600		218,143,627,430

(b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

2 2 5 マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位 : 円)

	(2021年11月30日現在)	(2022年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	137,347,416	368,069,569
コール・ローン	4,050,827,173	2,271,021,676
株式	97,883,970,640	125,784,079,960
派生商品評価勘定	-	51,424,400
未収配当金	527,630,760	787,322,520
前払金	128,810,000	-
差入委託証拠金	47,138,000	39,102,000
流動資産合計	102,775,723,989	129,301,020,125
資産合計	102,775,723,989	129,301,020,125
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	255,324,100	2,759,700
前受金	-	49,720,000
未払解約金	6,001,902	2,826,312
その他未払費用	9,485	8,270
流動負債合計	261,335,487	55,314,282
負債合計	261,335,487	55,314,282
純資産の部		

元本等		
元本	28,339,379,860	34,776,887,242
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	74,175,008,642	94,468,818,601
元本等合計	102,514,388,502	129,245,705,843
純資産合計	102,514,388,502	129,245,705,843
負債純資産合計	102,775,723,989	129,301,020,125

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年11月30日現在)	(2022年11月30日現在)
1. 担保資産	デリバティブ取引に係る差入委託証拠金 代用有価証券として担保に供している資産は次の通りであります。	デリバティブ取引に係る差入委託証拠金 代用有価証券として担保に供している資産は次の通りであります。

	株式 674,000,000円	株式 808,100,000円
2. 当計算期間の末日における 受益権の総数	28,339,379,860口	34,776,887,242口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.6174円 (1万口当たりの純資産額36,174円)	1口当たり純資産額 3.7164円 (1万口当たりの純資産額37,164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12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、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と、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11月30日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

		契 約 額 等		
--	--	---------	--	--

区 分	種 類		うち	時 価	評価損益
			1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	NK225 先物 0312月	4,870,284,100	-	4,614,960,000	255,324,100
	小計	4,870,284,100	-	4,614,960,000	255,324,100
合 計		4,870,284,100	-	4,614,960,000	255,324,100

(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	NK225 先物 0412月	3,400,255,300	-	3,448,920,000	48,664,700
	小計	3,400,255,300	-	3,448,920,000	48,664,700
合 計		3,400,255,300	-	3,448,920,000	48,664,700

(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12月1日 至 2022年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2021年11月30日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	29,682,506,040円
同期中における追加設定元本額	3,707,289,842円
同期中における一部解約元本額	5,050,416,022円
2021年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・225オープン	25,535,238,425円
三井住友・DC年金日本株式225ファンド	2,411,662,592円
SMB C・DCインデックスファンド(日経225)	281,684,884円
三井住友DS・日経225インデックス・ファンド	19,228,634円

日本株式225ファンドVA<適格機関投資家専用>	91,565,325円
合計	28,339,379,860円

(2022年11月30日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	28,339,379,860円
同期中における追加設定元本額	16,323,741,365円
同期中における一部解約元本額	9,886,233,983円
2022年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・225オープン	31,600,774,848円
三井住友・DC年金日本株式225ファンド	2,357,385,245円
S M B C・DCインデックスファンド(日経225)	658,797,360円
三井住友D S・日経225インデックス・ファンド	73,400,444円
日本株式225ファンドVA<適格機関投資家専用>	86,529,345円
合計	34,776,887,242円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

(単位:円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
日本水産	154,000	522.000	80,388,000	
I N P E X	61,600	1,533.000	94,432,800	
コムシスホールディングス	154,000	2,467.000	379,918,000	
大成建設	30,800	4,165.000	128,282,000	
大林組	154,000	1,024.000	157,696,000	
清水建設	154,000	738.000	113,652,000	
長谷工コーポレーション	30,800	1,517.000	46,723,600	
鹿島建設	77,000	1,550.000	119,350,000	
大和ハウス	154,000	3,159.000	486,486,000	
積水ハウス	154,000	2,567.000	395,318,000	
日揮ホールディングス	154,000	1,893.000	291,522,000	
日清製粉G本社	154,000	1,615.000	248,710,000	
明治ホールディングス	30,800	6,600.000	203,280,000	
日本ハム	77,000	3,700.000	284,900,000	
サッポロホールディングス	30,800	3,590.000	110,572,000	
アサヒグループホールディングス	154,000	4,398.000	677,292,000	
麒麟HD	154,000	2,165.000	333,410,000	
宝ホールディングス	154,000	1,068.000	164,472,000	
キッコーマン	154,000	7,720.000	1,188,880,000	
味の素	154,000	4,335.000	667,590,000	
ニチレイ	77,000	2,781.000	214,137,000	
日本たばこ産業	154,000	2,815.500	433,587,000	
東洋紡	15,400	1,035.000	15,939,000	
帝人	30,800	1,328.000	40,902,400	

東レ	154,000	738.600	113,744,400
王子ホールディングス	154,000	528.000	81,312,000
日本製紙	15,400	965.000	14,861,000
クラレ	154,000	1,096.000	168,784,000
旭化成	154,000	1,019.000	156,926,000
昭和電工	15,400	2,188.000	33,695,200
住友化学	154,000	498.000	76,692,000
日産化学	154,000	6,740.000	1,037,960,000
東ソー	77,000	1,623.000	124,971,000
トクヤマ	30,800	1,913.000	58,920,400
デンカ	30,800	3,310.000	101,948,000
信越化学	154,000	17,570.000	2,705,780,000
三井化学	30,800	3,100.000	95,480,000
三菱ケミカルグループ	77,000	729.200	56,148,400
UBE	15,400	1,999.000	30,784,600
花王	154,000	5,461.000	840,994,000
DIC	15,400	2,506.000	38,592,400
富士フイルムHLDGS	154,000	7,315.000	1,126,510,000
資生堂	154,000	5,799.000	893,046,000
日東電工	154,000	8,610.000	1,325,940,000
協和キリン	154,000	3,175.000	488,950,000
武田薬品	154,000	4,050.000	623,700,000
アステラス製薬	770,000	2,128.000	1,638,560,000
住友ファーマ	154,000	1,067.000	164,318,000
塩野義製薬	154,000	6,950.000	1,070,300,000
中外製薬	462,000	3,624.000	1,674,288,000
エーザイ	154,000	9,332.000	1,437,128,000
第一三共	462,000	4,518.000	2,087,316,000
大塚ホールディングス	154,000	4,690.000	722,260,000
出光興産	61,600	3,240.000	199,584,000
Eneosホールディングス	154,000	466.000	71,764,000
横浜ゴム	77,000	2,255.000	173,635,000
ブリヂストン	154,000	5,167.000	795,718,000
AGC	30,800	4,600.000	141,680,000
日本板硝子	15,400	604.000	9,301,600
日本電気硝子	46,200	2,532.000	116,978,400
住友大阪セメント	15,400	3,235.000	49,819,000
太平洋セメント	15,400	2,167.000	33,371,800
東海カーボン	154,000	1,047.000	161,238,000
TOTO	77,000	4,745.000	365,365,000
日本碍子	154,000	1,811.000	278,894,000
日本製鉄	15,400	2,192.500	33,764,500
神戸製鋼所	15,400	620.000	9,548,000
JFEホールディングス	15,400	1,526.000	23,500,400
大平洋金属	15,400	2,050.000	31,570,000
日本軽金属HD	15,400	1,532.000	23,592,800
三井金属	15,400	3,135.000	48,279,000
東邦亜鉛	15,400	2,159.000	33,248,600

三菱マテリアル	15,400	2,187.000	33,679,800
住友鉱山	77,000	4,645.000	357,665,000
DOWAホールディングス	30,800	4,520.000	139,216,000
古河電工	15,400	2,597.000	39,993,800
住友電工	154,000	1,600.500	246,477,000
フジクラ	154,000	1,117.000	172,018,000
SUMCO	15,400	2,023.000	31,154,200
日本製鋼所	30,800	2,920.000	89,936,000
オークマ	30,800	5,210.000	160,468,000
アマダ	154,000	1,098.000	169,092,000
SMC	15,400	61,760.000	951,104,000
小松製作所	154,000	3,179.000	489,566,000
住友重機械	30,800	2,912.000	89,689,600
日立建機	154,000	3,210.000	494,340,000
クボタ	154,000	2,030.000	312,620,000
荏原製作所	30,800	5,260.000	162,008,000
ダイキン工業	154,000	22,405.000	3,450,370,000
日本精工	154,000	760.000	117,040,000
N T N	154,000	290.000	44,660,000
ジェイテクト	154,000	1,010.000	155,540,000
三井E & S H D	15,400	413.000	6,360,200
日立造船	30,800	896.000	27,596,800
三菱重工業	15,400	5,457.000	84,037,800
I H I	15,400	3,760.000	57,904,000
コニカミノルタ	154,000	569.000	87,626,000
ミネベアミツミ	154,000	2,243.000	345,422,000
日立	30,800	7,299.000	224,809,200
三菱電機	154,000	1,377.500	212,135,000
富士電機	30,800	5,620.000	173,096,000
安川電機	154,000	4,445.000	684,530,000
日本電産	123,200	8,534.000	1,051,388,800
オムロン	154,000	7,044.000	1,084,776,000
ジーエス・ユアサ コーポ	30,800	2,161.000	66,558,800
日本電気	15,400	4,855.000	74,767,000
富士通	15,400	18,465.000	284,361,000
セイコーエプソン	308,000	2,152.000	662,816,000
パナソニック ホールディング	154,000	1,274.000	196,196,000
シャープ	154,000	973.000	149,842,000
ソニーグループ	154,000	11,255.000	1,733,270,000
T D K	462,000	4,880.000	2,254,560,000
アルプスアルパイン	154,000	1,302.000	200,508,000
横河電機	154,000	2,566.000	395,164,000
アドバンテスト	308,000	9,130.000	2,812,040,000
キーエンス	15,400	57,140.000	879,956,000
カシオ	154,000	1,340.000	206,360,000
ファナック	154,000	20,365.000	3,136,210,000
京セラ	308,000	6,981.000	2,150,148,000
太陽誘電	154,000	4,365.000	672,210,000

村田製作所	123,200	7,464.000	919,564,800
S C R E E Nホールディングス	30,800	9,030.000	278,124,000
キヤノン	231,000	3,212.000	741,972,000
リ コ ー	154,000	1,086.000	167,244,000
東京エレクトロン	154,000	45,090.000	6,943,860,000
デンソー	154,000	7,514.000	1,157,156,000
川崎重工業	15,400	2,926.000	45,060,400
日産自動車	154,000	491.200	75,644,800
いすゞ自動車	77,000	1,794.000	138,138,000
トヨタ自動車	770,000	2,010.500	1,548,085,000
日野自動車	154,000	620.000	95,480,000
三菱自動車工業	15,400	636.000	9,794,400
マ ッ ダ	30,800	1,091.000	33,602,800
本田技研	308,000	3,356.000	1,033,648,000
スズキ	154,000	4,913.000	756,602,000
S U B A R U	154,000	2,351.500	362,131,000
ヤマハ発動機	154,000	3,415.000	525,910,000
テ ル モ	616,000	4,043.000	2,490,488,000
ニコン	154,000	1,334.000	205,436,000
オリンパス	616,000	2,806.000	1,728,496,000
H O Y A	77,000	14,060.000	1,082,620,000
シチズン時計	154,000	600.000	92,400,000
バンダイナムコH L D G S	154,000	9,045.000	1,392,930,000
凸版印刷	77,000	2,132.000	164,164,000
大日本印刷	77,000	2,841.000	218,757,000
ヤマハ	154,000	5,410.000	833,140,000
任 天 堂	154,000	5,894.000	907,676,000
東京電力H D	15,400	499.000	7,684,600
中部電力	15,400	1,288.000	19,835,200
関西電力	15,400	1,166.000	17,956,400
東京瓦斯	30,800	2,526.000	77,800,800
大阪瓦斯	30,800	2,122.000	65,357,600
東武鉄道	30,800	3,310.000	101,948,000
東急	77,000	1,749.000	134,673,000
小田急電鉄	77,000	1,802.000	138,754,000
京王電鉄	30,800	5,120.000	157,696,000
京成電鉄	77,000	3,915.000	301,455,000
東日本旅客鉄道	15,400	7,811.000	120,289,400
西日本旅客鉄道	15,400	5,836.000	89,874,400
東海旅客鉄道	15,400	16,630.000	256,102,000
ヤマトホールディングス	154,000	2,293.000	353,122,000
N I P P O N E X P R E S S	15,400	8,090.000	124,586,000
日本郵船	46,200	3,037.000	140,309,400
商船三井	46,200	3,365.000	155,463,000
川崎汽船	46,200	2,598.000	120,027,600
A N Aホールディングス	15,400	2,944.500	45,345,300
三菱倉庫	77,000	3,340.000	257,180,000
ネクソン	308,000	2,894.000	891,352,000

Zホールディングス	61,600	373.500	23,007,600	
トレンドマイクロ	154,000	6,810.000	1,048,740,000	
日本電信電話	61,600	3,820.000	235,312,000	
KDDI	924,000	4,111.000	3,798,564,000	
ソフトバンク	154,000	1,497.500	230,615,000	
東宝	15,400	5,290.000	81,466,000	
NTTデータ	770,000	2,102.000	1,618,540,000	
コナミグループ	154,000	6,450.000	993,300,000	
ソフトバンクグループ	924,000	5,952.000	5,499,648,000	
双日	15,400	2,438.000	37,545,200	
伊藤忠	154,000	4,287.000	660,198,000	
丸紅	154,000	1,548.000	238,392,000	
豊田通商	154,000	5,230.000	805,420,000	
三井物産	154,000	3,983.000	613,382,000	
住友商事	154,000	2,247.000	346,038,000	
三菱商事	154,000	4,605.000	709,170,000	
J. フロント リテイリング	77,000	1,159.000	89,243,000	
三越伊勢丹HD	154,000	1,324.000	203,896,000	
セブン&アイ・HLDGS	154,000	5,579.000	859,166,000	
高島屋	77,000	1,786.000	137,522,000	
丸井グループ	154,000	2,334.000	359,436,000	
イオン	154,000	2,823.000	434,742,000	
ファーストリテイリング	154,000	80,810.000	12,444,740,000	代用有価証券 10,000株
しずおかフィナンシャルク	154,000	1,005.000	154,770,000	
コンコルディア・フィナンシャル	154,000	477.000	73,458,000	
あおぞら銀行	15,400	2,595.000	39,963,000	
三菱UFJフィナンシャルG	154,000	755.100	116,285,400	
りそなホールディングス	15,400	660.900	10,177,860	
三井住友トラストHD	15,400	4,407.000	67,867,800	
三井住友フィナンシャルG	15,400	4,673.000	71,964,200	
千葉銀行	154,000	834.000	128,436,000	
ふくおかフィナンシャルG	30,800	2,691.000	82,882,800	
みずほフィナンシャルG	15,400	1,717.000	26,441,800	
大和証券G本社	154,000	608.000	93,632,000	
野村ホールディングス	154,000	500.700	77,107,800	
松井証券	154,000	786.000	121,044,000	
SOMPOホールディングス	30,800	6,059.000	186,617,200	
MS&AD	46,200	4,100.000	189,420,000	
第一生命HLDGS	15,400	2,543.500	39,169,900	
東京海上HD	231,000	2,827.000	653,037,000	
T&Dホールディングス	30,800	1,668.000	51,374,400	
クレディセゾン	154,000	1,757.000	270,578,000	
オリックス	154,000	2,210.500	340,417,000	
日本取引所グループ	154,000	1,975.500	304,227,000	
東急不動産HD	154,000	742.000	114,268,000	
三井不動産	154,000	2,776.500	427,581,000	
三菱地所	154,000	1,940.000	298,760,000	

東京建物	77,000	1,921.000	147,917,000
住友不動産	154,000	3,716.000	572,264,000
エムスリー	369,600	4,205.000	1,554,168,000
ディー・エヌ・エー	46,200	1,850.000	85,470,000
電通グループ	154,000	4,400.000	677,600,000
サイバーエージェント	123,200	1,229.000	151,412,800
楽天グループ	154,000	653.000	100,562,000
リクルートホールディングス	462,000	4,329.000	1,999,998,000
日本郵政	154,000	1,078.000	166,012,000
セコム	154,000	8,485.000	1,306,690,000
合計	29,475,600		125,784,079,960

(b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

外国株式インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2021年11月30日現在)	(2022年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	3,811,427,167	12,344,954,615
金銭信託	42,505,540	306,406,160
コール・ローン	1,253,628,220	1,890,553,005
株式	338,023,942,089	411,677,365,126
投資証券	8,338,643,304	10,072,502,218
派生商品評価勘定	37,540,884	487,638,687
未収入金	12,431,617	1,756,879
未収配当金	378,251,525	582,453,884
差入委託証拠金	2,070,129,203	5,033,061,489
流動資産合計	353,968,499,549	442,396,692,063
資産合計	353,968,499,549	442,396,692,063
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	68,909,977	34,123,826
未払解約金	81,347,754	161,000,409
その他未払費用	5,026	6,376
流動負債合計	150,262,757	195,130,611
負債合計	150,262,757	195,130,611
純資産の部		
元本等		
元本	60,650,874,522	72,186,242,919

剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	293,167,362,270	370,015,318,533
元本等合計	353,818,236,792	442,201,561,452
純資産合計	353,818,236,792	442,201,561,452
負債純資産合計	353,968,499,549	442,396,692,063

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	（2021年11月30日現在）	（2022年11月30日現在）
1. 当計算期間の末日における 受益権の総数	60,650,874,522口	72,186,242,919口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 5.8337円 （1万口当たりの純資産額58,337円）	1口当たり純資産額 6.1258円 （1万口当たりの純資産額61,258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12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、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と、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11月30日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券（株式、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

		契 約 額 等		
--	--	---------	--	--

区 分	種 類		うち	時 価	評 価 損 益
			1 年 超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	S&P 500 EMINI FUT DEC21	5,874,650,474	-	5,899,958,611	25,308,137
	SPI 200 FUTURES DEC21	254,521,022	-	249,231,076	5,289,946
	FTSE 100 IDX FUT DEC21	329,071,619	-	323,504,820	5,566,799
	EURO STOXX 50 DEC21	1,184,808,252	-	1,138,863,154	45,945,098
	小計	7,643,051,367	-	7,611,557,661	31,493,706
	合 計	7,643,051,367	-	7,611,557,661	31,493,706

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち 1 年 超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	952,169,526	-	952,205,922	36,396
	カナダ・ドル	41,953,946	-	41,950,840	3,106
	オーストラリア・ド ル	28,422,056	-	28,450,989	28,933
	香港・ドル	7,003,200	-	7,002,864	336
	シンガポール・ドル	3,321,476	-	3,328,212	6,736
	ニュージーランド・ ドル	775,611	-	775,253	358
	イギリス・ポンド	43,988,230	-	43,952,400	35,830
	スイス・フラン	30,751,765	-	30,813,540	61,775
	デンマーク・クロー ネ	7,079,634	-	7,080,999	1,365
	ノルウェー・クロー ネ	1,893,189	-	1,891,392	1,797
	スウェーデン・ク ローナ	10,871,469	-	10,901,754	30,285
	ユーロ	136,120,067	-	136,120,617	550
	小計	1,264,350,169	-	1,264,474,782	124,613
	合 計	1,264,350,169	-	1,264,474,782	124,613

(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

		契 約 額 等		

区 分	種 類		うち	時 価	評価損益
			1 年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	S&P 500 EMINI FUT DEC22	15,697,974,160	-	15,983,395,407	285,421,247
	SPI 200 FUTURES DEC22	734,736,737	-	757,862,325	23,125,588
	FTSE 100 IDX FUT DEC22	934,911,597	-	963,434,172	28,522,575
	EURO STOXX 50 DEC22	2,969,277,474	-	3,089,695,148	120,417,674
	小計	20,336,899,968	-	20,794,387,052	457,487,084
	合 計	20,336,899,968	-	20,794,387,052	457,487,084

(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	2,099,249,487	-	2,098,826,011	423,476
	カナダ・ドル	106,801,796	-	105,519,193	1,282,603
	オーストラリア・ド ル	34,202,370	-	33,957,955	244,415
	イギリス・ボンド	87,718,707	-	87,086,511	632,196
	スイス・フラン	91,286,164	-	90,606,304	679,860
	デンマーク・クロー ネ	24,504,100	-	24,483,812	20,288
	スウェーデン・ク ローナ	30,621,024	-	30,535,733	85,291
	ユーロ	171,328,650	-	170,699,141	629,509
	小計	2,645,712,298	-	2,641,714,660	3,997,638
	売建				
	オーストラリア・ド ル	72,454,928	-	72,740,539	285,611
	イギリス・ボンド	89,625,998	-	89,588,968	37,030
	ユーロ	305,223,048	-	304,949,052	273,996
	小計	467,303,974	-	467,278,559	25,415
合 計	3,113,016,272	-	3,108,993,219	3,972,223	

(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12月1日 至 2022年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2021年11月30日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	58,935,911,745円
同期中における追加設定元本額	3,825,327,501円
同期中における一部解約元本額	2,110,364,724円
2021年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	31,877,680,130円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	257,237,232円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,092,113,150円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	759,876,748円
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)	63,296,820円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	1,131,648円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	5,750,140円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	17,334,902円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	47,583,616円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	49,206,031円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	93,432,630円
外国株式指数ファンド	762,591,588円
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	12,154,970,474円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	136,154,453円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	161,478,755円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	106,177,098円

イオン・バランス戦略ファンド	26,039,960円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2050	15,113,153円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	110,598,046円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	97,319,132円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	330,128,909円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	170,705,412円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	195,254,066円
三井住友・D C つみたてN I S A ・世界分散ファンド	38,559,109円
三井住友D S ・外国株式インデックス年金ファンド	509,621,059円
三井住友D S ・年金バランス30(債券重点型)	4,097,387円
三井住友D S ・年金バランス50(標準型)	17,354,910円
三井住友D S ・年金バランス70(株式重点型)	15,630,593円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2060	2,093,613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)	110,450,992円
日興F W S ・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	67,713,873円
日興F W S ・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	281,821,366円
三井住友D S ・先進国株式インデックス・ファンド	12,792,410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)	591,445,429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 >	3,447,518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 >	32,980,346円
S M A M ・ バランスファンドV A 25 < 適格機関投資家専用 >	704,179,317円
S M A M ・ バランスファンドV A 37.5 < 適格機関投資家専用 >	824,854,056円
S M A M ・ バランスファンドV A 50 < 適格機関投資家専用 >	3,604,698,411円
S M A M ・ バランスファンドV L 30 < 適格機関投資家限定 >	12,109,077円
S M A M ・ バランスファンドV L 50 < 適格機関投資家限定 >	64,600,386円
S M A M ・ バランスファンドV A 75 < 適格機関投資家専用 >	508,707,107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 >	41,029,721円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 25 < 適格機関投資家専用 >	102,099,408円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 50 < 適格機関投資家専用 >	495,008,013円
S M A M ・ バランスファンドV A 40 < 適格機関投資家専用 >	350,695,262円
S M A M ・ バランスファンドV A 35 < 適格機関投資家専用 >	829,398,471円
S M A M ・ バランスV A 株40T < 適格機関投資家限定 >	218,848円
三井住友・外国株式インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	218,605,667円
S M A M ・ グローバルバランス40V A < 適格機関投資家限定 >	75,145,593円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 20A < 適格機関投資家専用 >	8,737,379円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 35A < 適格機関投資家専用 >	7,911,776円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 50A < 適格機関投資家専用 >	4,096,558円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 20L < 適格機関投資家専用 >	21,448,701円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 25L < 適格機関投資家専用 >	60,189,060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 >	139,958,110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 >	63,429,174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 >	817,767,596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 >	118,979,244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 >	1,028,620,924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 >	27,233,124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 >	37,994,675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 >	41,244,635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 >	222,731,531円
合 計	60,650,874,522円

(2022年11月30日現在)

開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	60,650,874,522円
同期中における追加設定元本額	22,050,143,482円
同期中における一部解約元本額	10,514,775,085円
2022年11月30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	36,369,253,618円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	284,736,068円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,090,013,037円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	785,999,194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)	33,400,233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)	1,017,107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)	5,342,658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)	16,884,192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)	49,323,143円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	54,445,231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)	105,113,958円
外国株式指数ファンド	936,693,371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	17,542,779,547円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	90,349,697円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	117,821,294円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	75,689,448円
イオン・バランス戦略ファンド	20,982,589円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2050	21,006,539円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	130,889,105円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	118,201,443円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	437,684,453円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	238,781,337円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	274,840,665円
三井住友・DCつみたてN I S A ・ 世界分散ファンド	54,612,889円
三井住友D S ・ 外国株式インデックス年金ファンド	1,637,991,448円
三井住友D S ・ 年金バランス30(債券重点型)	10,892,390円
三井住友D S ・ 年金バランス50(標準型)	47,697,547円
三井住友D S ・ 年金バランス70(株式重点型)	42,074,552円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2060	2,714,893円
S M B C ・ DCインデックスファンド(M S C I コクサイ)	397,450,005円
日興F W S ・ 先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	250,037,372円
日興F W S ・ 先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	1,466,576,467円
三井住友D S ・ 先進国株式インデックス・ファンド	50,536,075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)	449,296,410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 >	3,279,377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 >	20,004,315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 >	536,704,870円

SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	702,957,041円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	3,074,190,088円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	9,972,101円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	49,989,232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>	36,093,954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>	427,001,205円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	293,567,068円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	687,726,675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)	194,459,687円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	59,953,329円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	7,255,976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>	17,103,227円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	51,782,752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>	110,286,434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>	46,890,632円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	281,352,925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>	1,662,845,853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>	17,217,947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>	1,803,118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>	2,321,567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>	74,738,213円
合計	72,186,242,919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	APA CORP	19,759	46.590	920,571.81	
	BAKER HUGHES CO	60,981	28.650	1,747,105.65	
	CHENIERE ENERGY INC	14,977	172.650	2,585,779.05	
	CHEVRON CORP	118,131	181.030	21,385,254.93	
	CONOCOPHILLIPS	82,511	124.250	10,251,991.75	
	COTERRA ENERGY INC	49,908	28.070	1,400,917.56	
	DEVON ENERGY CORP	40,169	67.500	2,711,407.50	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	11,049	146.740	1,621,330.26	
	EOG RESOURCES INC	37,069	141.290	5,237,479.01	
	EQT CORP	19,298	42.660	823,252.68	
EXXON MOBIL CORP	267,258	110.540	29,542,699.32		

HALLIBURTON CO	54,852	37.160	2,038,300.32	
HESS CORP	17,913	141.980	2,543,287.74	
KINDER MORGAN INC	127,394	18.880	2,405,198.72	
MARATHON OIL CORP	42,380	30.350	1,286,233.00	
MARATHON PETROLEUM CORP	34,363	123.470	4,242,799.61	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	58,643	69.110	4,052,817.73	
ONEOK INC	28,226	64.910	1,832,149.66	
PHILLIPS 66	31,280	108.970	3,408,581.60	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	14,547	240.780	3,502,626.66	
SCHLUMBERGER LTD	89,455	51.050	4,566,677.75	
TARGA RESOURCES CORP	12,350	73.720	910,442.00	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	417	2,506.380	1,045,160.46	
VALERO ENERGY CORP	25,828	135.200	3,491,945.60	
WILLIAMS COS INC	75,529	34.320	2,592,155.28	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	13,678	302.180	4,133,218.04	
ALBEMARLE CORP	7,433	270.020	2,007,058.66	
ALCOA CORP	11,849	47.700	565,197.30	
AMCOR PLC	97,610	12.110	1,182,057.10	
AVERY DENNISON CORP	5,454	188.420	1,027,642.68	
BALL CORP	19,410	54.740	1,062,503.40	
CELANESE CORP	6,643	105.550	701,168.65	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	14,020	106.400	1,491,728.00	
CLEVELAND-CLIFFS INC	33,403	15.140	505,721.42	
CORTEVA INC	44,440	65.570	2,913,930.80	
CROWN HOLDINGS INC	6,863	80.230	550,618.49	
DOW INC	44,543	50.650	2,256,102.95	
DUPONT DE NEMOURS INC	30,490	69.460	2,117,835.40	
EASTMAN CHEMICAL CO	7,027	85.250	599,051.75	
ECOLAB INC	16,460	144.910	2,385,218.60	
FMC CORP	8,548	127.710	1,091,665.08	
FREEPORT-MCMORAN INC	94,169	37.510	3,532,279.19	
INTERNATIONAL PAPER CO	23,472	36.330	852,737.76	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	15,629	102.400	1,600,409.60	
LINDE PLC	32,085	331.970	10,651,257.45	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	17,144	84.840	1,454,496.96	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,203	357.540	1,502,740.62	
MOSAIC CO/THE	21,306	50.730	1,080,853.38	
NEWMONT CORP	50,898	45.760	2,329,092.48	
NUCOR CORP	17,484	146.990	2,569,973.16	
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,550	132.690	736,429.50	
PPG INDUSTRIES INC	15,181	131.830	2,001,311.23	
RPM INTERNATIONAL INC	7,696	101.670	782,452.32	
SEALED AIR CORP	7,895	52.030	410,776.85	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	15,187	241.570	3,668,723.59	

STEEL DYNAMICS INC	12,713	102.640	1,304,862.32
VULCAN MATERIALS CO	8,762	178.450	1,563,578.90
WESTLAKE CORP	2,189	107.170	234,595.13
WESTROCK CO	16,766	36.720	615,647.52
3M CO	35,101	126.130	4,427,289.13
AERCAP HOLDINGS NV	8,780	60.240	528,907.20
ALLEGION PLC	4,764	110.770	527,708.28
AMETEK INC	14,928	139.010	2,075,141.28
BOEING CO/THE	35,354	175.320	6,198,263.28
CARLISLE COS INC	3,499	255.530	894,099.47
CARRIER GLOBAL CORP	55,822	43.520	2,429,373.44
CATERPILLAR INC	34,065	235.120	8,009,362.80
CUMMINS INC	9,144	246.420	2,253,264.48
DEERE & CO	18,594	440.970	8,199,396.18
DOVER CORP	8,929	139.370	1,244,434.73
EATON CORP PLC	25,062	162.150	4,063,803.30
EMERSON ELECTRIC CO	36,697	94.310	3,460,894.07
FASTENAL CO	37,051	50.270	1,862,553.77
FORTIVE CORP	21,981	65.600	1,441,953.60
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	7,166	65.740	471,092.84
GENERAC HOLDINGS INC	3,973	100.660	399,922.18
GENERAL DYNAMICS CORP	14,867	251.220	3,734,887.74
GENERAL ELECTRIC CO	70,721	85.660	6,057,960.86
HEICO CORP	3,085	156.570	483,018.45
HEICO CORP-CLASS A	4,570	122.430	559,505.10
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	43,497	216.720	9,426,669.84
HOWMET AEROSPACE INC	23,889	37.220	889,148.58
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,888	228.020	658,521.76
IDEX CORP	4,788	231.060	1,106,315.28
ILLINOIS TOOL WORKS	19,622	224.370	4,402,588.14
INGERSOLL-RAND INC	25,011	52.820	1,321,081.02
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	11,600	48.600	563,760.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	42,895	65.400	2,805,333.00
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	11,965	225.610	2,699,423.65
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,104	260.830	548,786.32
LOCKHEED MARTIN CORP	15,336	484.100	7,424,157.60
MASCO CORP	14,885	49.870	742,314.95
NORDSON CORP	2,884	230.800	665,627.20
NORTHROP GRUMMAN CORP	9,511	528.350	5,025,136.85
OTIS WORLDWIDE CORP	25,348	76.880	1,948,754.24
OWENS CORNING	5,205	89.630	466,524.15
PACCAR INC	21,897	104.260	2,282,981.22
PARKER HANNIFIN CORP	8,047	294.290	2,368,151.63
PENTAIR PLC	8,220	44.680	367,269.60

PLUG POWER INC	28,584	14.900	425,901.60
QUANTA SERVICES INC	8,891	144.550	1,285,194.05
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	93,088	97.430	9,069,563.84
ROCKWELL AUTOMATION INC	7,031	259.630	1,825,458.53
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,600	44.000	334,400.00
SMITH (A.O.) CORP	7,157	60.490	432,926.93
SNAP-ON INC	3,106	239.180	742,893.08
STANLEY BLACK & DECKER INC	9,129	80.510	734,975.79
TEXTRON INC	14,870	70.330	1,045,807.10
TRANE TECHNOLOGIES PLC	14,363	174.990	2,513,381.37
TRANSDIGM GROUP INC	3,374	609.880	2,057,735.12
UNITED RENTALS INC	4,798	342.730	1,644,418.54
WABTEC CORP	11,284	98.700	1,113,730.80
WW GRAINGER INC	2,797	590.990	1,652,999.03
XYLEM INC	12,201	109.880	1,340,645.88
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	8,029	106.070	851,636.03
CINTAS CORP	5,707	450.690	2,572,087.83
CLARIVATE PLC	19,939	9.170	182,840.63
COPART INC	27,584	64.440	1,777,512.96
COSTAR GROUP INC	25,116	78.250	1,965,327.00
EQUIFAX INC	7,922	188.920	1,496,624.24
JACOBS SOLUTIONS INC	8,422	122.770	1,033,968.94
LEIDOS HOLDINGS INC	8,863	108.500	961,635.50
REPUBLIC SERVICES INC	14,232	136.650	1,944,802.80
ROBERT HALF INTL INC	8,149	76.210	621,035.29
ROLLINS INC	16,081	39.830	640,506.23
TRANSUNION	11,233	60.460	679,147.18
VERISK ANALYTICS INC	9,674	176.930	1,711,620.82
WASTE CONNECTIONS INC	16,122	140.820	2,270,300.04
WASTE MANAGEMENT INC	26,828	165.080	4,428,766.24
AMERCO-NON VOTING	5,850	60.180	352,053.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,726	97.600	851,657.60
CSX CORP	137,254	32.170	4,415,461.18
DELTA AIR LINES INC	8,299	34.610	287,228.39
EXPEDITORS INTL WASH INC	10,436	113.560	1,185,112.16
FEDEX CORP	15,488	177.820	2,754,076.16
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	96,661	2.830	273,550.63
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,530	179.830	994,459.90
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,940	54.790	435,032.60
LYFT INC-A	18,751	10.760	201,760.76
NORFOLK SOUTHERN CORP	15,062	253.360	3,816,108.32
OLD DOMINION FREIGHT LINE	6,292	292.070	1,837,704.44
SOUTHWEST AIRLINES CO	7,076	39.250	277,733.00
UBER TECHNOLOGIES INC	96,242	27.760	2,671,677.92

UNION PACIFIC CORP	40,207	212.770	8,554,843.39
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	47,001	184.890	8,690,014.89
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	6,249	21.420	133,853.58
APTIV PLC	17,416	101.880	1,774,342.08
BORGWARNER INC	17,433	41.930	730,965.69
FORD MOTOR CO	256,295	13.750	3,524,056.25
GENERAL MOTORS CO	87,113	39.750	3,462,741.75
LEAR CORP	3,736	140.150	523,600.40
LUCID GROUP INC	21,730	9.760	212,084.80
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	19,354	28.850	558,362.90
TESLA INC	167,195	180.830	30,233,871.85
DR HORTON INC	20,992	84.220	1,767,946.24
GARMIN LTD	10,774	89.810	967,612.94
HASBRO INC	7,491	62.170	465,715.47
LENNAR CORP-A	17,126	86.400	1,479,686.40
LULULEMON ATHLETICA INC	7,214	363.320	2,620,990.48
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	100.940	288,991.22
NEWELL BRANDS INC	26,997	12.870	347,451.39
NIKE INC -CL B	81,197	106.250	8,627,181.25
NVR INC	173	4,557.920	788,520.16
PULTEGROUP INC	13,075	44.090	576,476.75
VF CORP	20,583	32.460	668,124.18
WHIRLPOOL CORP	3,212	145.980	468,887.76
AIRBNB INC-CLASS A	23,260	95.380	2,218,538.80
ARAMARK	13,242	40.570	537,227.94
BOOKING HOLDINGS INC	2,617	2,017.160	5,278,907.72
CAESARS ENTERTAINMENT INC	13,336	48.870	651,730.32
CARNIVAL CORP	69,745	9.750	680,013.75
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,745	1,552.720	2,709,496.40
DARDEN RESTAURANTS INC	7,606	144.960	1,102,565.76
DOMINO'S PIZZA INC	2,121	383.060	812,470.26
EXPEDIA GROUP INC	10,081	102.450	1,032,798.45
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	17,462	138.750	2,422,852.50
LAS VEGAS SANDS CORP	23,449	44.660	1,047,232.34
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	18,185	161.260	2,932,513.10
MCDONALD'S CORP	46,804	271.410	12,703,073.64
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,198	35.860	796,020.28
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,097	59.930	964,693.21
STARBUCKS CORP	73,409	98.660	7,242,531.94
VAIL RESORTS INC	2,860	256.300	733,018.00
WYNN RESORTS LTD	7,730	80.290	620,641.70
YUM! BRANDS INC	18,046	126.040	2,274,517.84
ADVANCE AUTO PARTS INC	3,426	147.930	506,808.18
AMAZON.COM INC	580,471	92.420	53,647,129.82

AUTOZONE INC	1,212	2,556.050	3,097,932.60
BATH & BODY WORKS INC	15,400	39.790	612,766.00
BEST BUY CO INC	12,132	84.160	1,021,029.12
BURLINGTON STORES INC	4,802	192.490	924,336.98
CARMAX INC	10,366	67.120	695,765.92
CHEWY INC - CLASS A	3,969	40.200	159,553.80
DOLLAR GENERAL CORP	14,255	252.850	3,604,376.75
DOLLAR TREE INC	13,992	146.500	2,049,828.00
DOORDASH INC - A	11,627	53.340	620,184.18
EBAY INC	35,551	43.770	1,556,067.27
ETSY INC	7,168	121.880	873,635.84
GENUINE PARTS CO	8,711	180.550	1,572,771.05
HOME DEPOT INC	65,045	315.960	20,551,618.20
LKQ CORP	15,922	52.930	842,751.46
LOWE'S COS INC	40,032	207.470	8,305,439.04
MERCADOLIBRE INC	2,889	889.260	2,569,072.14
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,265	849.730	3,624,098.45
POOL CORP	2,578	320.750	826,893.50
ROSS STORES INC	22,258	116.790	2,599,511.82
TARGET CORP	29,311	166.370	4,876,471.07
TJX COMPANIES INC	73,417	80.160	5,885,106.72
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,072	219.010	1,548,838.72
ULTA BEAUTY INC	3,287	449.880	1,478,755.56
WAYFAIR INC- CLASS A	3,756	31.670	118,952.52
COSTCO WHOLESALE CORP	28,136	528.960	14,882,818.56
KROGER CO	41,915	49.350	2,068,505.25
SYSCO CORP	31,126	85.090	2,648,511.34
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	46,212	41.080	1,898,388.96
WALMART INC	96,431	152.970	14,751,050.07
ALTRIA GROUP INC	116,480	45.820	5,337,113.60
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	36,518	96.450	3,522,161.10
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	18,950	71.120	1,347,724.00
BUNGE LTD	10,263	104.160	1,068,994.08
CAMPBELL SOUP CO	12,945	52.620	681,165.90
COCA-COLA CO/THE	262,091	62.480	16,375,445.68
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	13,260	51.570	683,818.20
CONAGRA BRANDS INC	30,896	36.960	1,141,916.16
CONSTELLATION BRANDS INC-A	10,439	253.640	2,647,747.96
GENERAL MILLS INC	37,327	82.840	3,092,168.68
HERSHEY CO/THE	8,925	230.490	2,057,123.25
HORMEL FOODS CORP	19,475	48.190	938,500.25
JM SMUCKER CO/THE	6,647	151.520	1,007,153.44
KELLOGG CO	15,843	72.400	1,147,033.20
KEURIG DR PEPPER INC	46,903	38.100	1,787,004.30

KRAFT HEINZ CO/THE	44,124	39.040	1,722,600.96
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	15,162	83.750	1,269,817.50
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	9,629	54.920	528,824.68
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	88,948	66.050	5,875,015.40
MONSTER BEVERAGE CORP	26,021	99.790	2,596,635.59
PEPSICO INC	87,989	182.590	16,065,911.51
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	99,061	97.790	9,687,175.19
TYSON FOODS INC-CL A	19,731	66.450	1,311,124.95
CHURCH & DWIGHT CO INC	14,330	79.490	1,139,091.70
CLOROX COMPANY	7,384	147.430	1,088,623.12
COLGATE-PALMOLIVE CO	50,068	75.970	3,803,665.96
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	14,245	214.940	3,061,820.30
KIMBERLY-CLARK CORP	21,336	133.160	2,841,101.76
PROCTER & GAMBLE CO/THE	151,847	145.480	22,090,701.56
ABBOTT LABORATORIES	110,813	105.000	11,635,365.00
ABIOMED INC	2,731	377.330	1,030,488.23
ALIGN TECHNOLOGY INC	4,914	191.830	942,652.62
AMERISOURCEBERGEN CORP	10,249	167.900	1,720,807.10
BAXTER INTERNATIONAL INC	30,726	55.340	1,700,376.84
BECTON DICKINSON AND CO	18,431	241.020	4,442,239.62
BOSTON SCIENTIFIC CORP	89,631	44.500	3,988,579.50
CARDINAL HEALTH INC	18,000	78.650	1,415,700.00
CENTENE CORP	36,696	84.420	3,097,876.32
CIGNA CORP	20,347	320.700	6,525,282.90
COOPER COS INC/THE	2,771	307.440	851,916.24
CVS HEALTH CORP	82,113	100.880	8,283,559.44
DAVITA INC	4,138	71.650	296,487.70
DENTSPLY SIRONA INC	11,864	30.210	358,411.44
DEXCOM INC	24,841	110.390	2,742,197.99
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	39,084	74.850	2,925,437.40
ELEVANCE HEALTH INC	15,116	515.360	7,790,181.76
HCA HEALTHCARE INC	14,575	235.810	3,436,930.75
HENRY SCHEIN INC	7,559	80.600	609,255.40
HOLOGIC INC	16,591	74.370	1,233,872.67
HUMANA INC	8,018	533.140	4,274,716.52
IDEXX LABORATORIES INC	5,548	408.960	2,268,910.08
INSULET CORP	4,263	288.560	1,230,131.28
INTUITIVE SURGICAL INC	22,662	258.800	5,864,925.60
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	6,245	239.780	1,497,426.10
MASIMO CORP	2,941	140.650	413,651.65
MCKESSON CORP	9,417	381.780	3,595,222.26
MEDTRONIC PLC	84,220	76.480	6,441,145.60
MOLINA HEALTHCARE INC	3,428	322.720	1,106,284.16
NOVOCURE LTD	6,929	74.680	517,457.72

QUEST DIAGNOSTICS INC	6,814	149.010	1,015,354.14
RESMED INC	8,775	223.200	1,958,580.00
STERIS PLC	6,271	178.390	1,118,683.69
STRYKER CORP	21,514	227.200	4,887,980.80
TELADOC HEALTH INC	7,496	27.130	203,366.48
TELEFLEX INC	3,067	226.150	693,602.05
UNITEDHEALTH GROUP INC	59,375	528.000	31,350,000.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,203	130.550	548,701.65
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	8,342	182.440	1,521,914.48
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	13,599	119.000	1,618,281.00
ABBVIE INC	112,430	158.200	17,786,426.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	19,556	150.940	2,951,782.64
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,912	204.790	1,620,298.48
AMGEN INC	33,461	281.990	9,435,667.39
AVANTOR INC	37,382	21.310	796,610.42
BIOGEN INC	9,574	291.410	2,789,959.34
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	11,557	97.120	1,122,415.84
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,220	399.550	487,451.00
BIO-TECHNE CORP	2,551	327.070	834,355.57
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	135,837	79.030	10,735,198.11
CATALENT INC	10,797	47.180	509,402.46
CHARLES RIVER LABORATORIES	3,467	239.500	830,346.50
DANAHER CORP	43,714	259.020	11,322,800.28
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	20,811	12.250	254,934.75
ELI LILLY & CO	51,114	363.950	18,602,940.30
EXACT SCIENCES CORP	9,771	41.190	402,467.49
GILEAD SCIENCES INC	79,125	85.760	6,785,760.00
HORIZON THERAPEUTICS PLC	13,945	78.760	1,098,308.20
ILLUMINA INC	10,327	208.570	2,153,902.39
INCYTE CORP	11,842	77.800	921,307.60
IQVIA HOLDINGS INC	12,401	212.500	2,635,212.50
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,089	155.650	636,452.85
JOHNSON & JOHNSON	166,536	176.090	29,325,324.24
MERCK & CO. INC.	160,911	108.840	17,513,553.24
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,369	1,412.210	1,933,315.49
MODERNA INC	21,941	173.150	3,799,084.15
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,359	121.740	774,144.66
PERKINELMER INC	8,323	133.650	1,112,368.95
PFIZER INC	356,455	49.490	17,640,957.95
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,837	736.080	5,032,578.96
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	20,785	43.070	895,209.95
SEAGEN INC	8,954	117.370	1,050,930.98
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	73,873	8.670	640,478.91
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	24,775	539.750	13,372,306.25

VERTEX PHARMACEUTICALS INC	16,159	316.330	5,111,576.47
VIATRIS INC	83,466	11.180	933,149.88
WATERS CORP	4,095	330.160	1,352,005.20
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	4,241	223.500	947,863.50
ZOETIS INC	29,434	147.850	4,351,816.90
BANK OF AMERICA CORP	458,912	37.000	16,979,744.00
CITIGROUP INC	120,748	47.570	5,743,982.36
CITIZENS FINANCIAL GROUP	30,366	41.790	1,268,995.14
FIFTH THIRD BANCORP	42,445	36.000	1,528,020.00
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	670	799.620	535,745.40
FIRST REPUBLIC BANK/CA	10,970	121.570	1,333,622.90
HUNTINGTON BANCSHARES INC	88,161	15.300	1,348,863.30
JPMORGAN CHASE & CO	186,539	136.560	25,473,765.84
KEYCORP	62,741	18.570	1,165,100.37
M & T BANK CORP	11,046	170.920	1,887,982.32
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	26,202	164.370	4,306,822.74
REGIONS FINANCIAL CORP	62,979	22.910	1,442,848.89
SIGNATURE BANK	4,335	135.580	587,739.30
SVB FINANCIAL GROUP	3,727	219.130	816,697.51
TRUIST FINANCIAL CORP	83,228	45.910	3,820,997.48
US BANCORP	91,339	44.590	4,072,806.01
WEBSTER FINANCIAL CORP	9,600	53.400	512,640.00
WELLS FARGO & CO	239,883	47.570	11,411,234.31
ALLY FINANCIAL INC	20,139	26.510	533,884.89
AMERICAN EXPRESS CO	40,511	154.420	6,255,708.62
AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,131	324.480	2,313,866.88
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	24,207	65.850	1,594,030.95
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	49,681	44.840	2,227,696.04
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	81,417	315.130	25,656,939.21
BLACKROCK INC	9,588	714.000	6,845,832.00
BLACKSTONE INC	45,304	88.210	3,996,265.84
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	24,892	102.080	2,540,975.36
CARLYLE GROUP INC/THE	10,094	29.880	301,608.72
CBOE GLOBAL MARKETS INC	7,323	123.250	902,559.75
CME GROUP INC	23,252	174.810	4,064,682.12
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	7,252	43.110	312,633.72
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	18,645	108.550	2,023,914.75
EQUITABLE HOLDINGS INC	22,820	30.840	703,768.80
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,377	449.120	1,067,558.24
FRANKLIN RESOURCES INC	21,778	26.300	572,761.40
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	5,375	58.500	314,437.50
GOLDMAN SACHS GROUP INC	21,977	383.710	8,432,794.67
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	35,337	105.340	3,722,399.58
INVESCO LTD	18,328	18.840	345,299.52

KKR & CO INC	37,308	50.550	1,885,919.40	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	4,992	239.910	1,197,630.72	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,653	256.080	679,380.24	
MOODY'S CORP	10,511	289.530	3,043,249.83	
MORGAN STANLEY	83,031	91.080	7,562,463.48	
MSCI INC	5,079	486.320	2,470,019.28	
NASDAQ INC	22,924	66.100	1,515,276.40	
NORTHERN TRUST CORP	13,026	91.760	1,195,265.76	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	11,520	115.370	1,329,062.40	
S&P GLOBAL INC	21,747	347.140	7,549,253.58	
SCHWAB (CHARLES) CORP	91,282	80.390	7,338,159.98	
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,481	61.380	336,423.78	
STATE STREET CORP	24,045	73.930	1,777,646.85	
SYNCHRONY FINANCIAL	32,112	37.280	1,197,135.36	
T ROWE PRICE GROUP INC	13,663	120.500	1,646,391.50	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	5,220	58.530	305,526.60	
AFLAC INC	37,779	70.880	2,677,775.52	
ALLSTATE CORP	18,070	133.380	2,410,176.60	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,866	139.960	681,045.36	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	50,566	61.440	3,106,775.04	
AON PLC-CLASS A	13,151	302.730	3,981,202.23	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	25,320	58.980	1,493,373.60	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	13,030	195.680	2,549,710.40	
ASSURANT INC	3,114	126.390	393,578.46	
BROWN & BROWN INC	14,273	57.360	818,699.28	
CHUBB LTD	26,975	216.680	5,844,943.00	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,510	108.130	1,136,446.30	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,288	269.240	346,781.12	
EVEREST RE GROUP LTD	2,755	332.800	916,864.00	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	19,058	39.570	754,125.06	
GLOBE LIFE INC	6,373	117.300	747,552.90	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	21,767	75.830	1,650,591.61	
LINCOLN NATIONAL CORP	8,677	38.090	330,506.93	
LOEWS CORP	12,727	57.780	735,366.06	
MARKEL CORP	837	1,290.610	1,080,240.57	
MARSH & MCLENNAN COS	31,765	168.680	5,358,120.20	
METLIFE INC	43,746	76.070	3,327,758.22	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	16,409	89.840	1,474,184.56	
PROGRESSIVE CORP	36,619	131.120	4,801,483.28	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	22,933	106.590	2,444,428.47	
TRAVELERS COS INC/THE	15,031	187.210	2,813,953.51	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,823	238.500	1,627,285.50	
WR BERKLEY CORP	14,486	75.040	1,087,029.44	
CBRE GROUP INC - A	20,793	76.460	1,589,832.78	

HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	79,100	3.980	314,818.00
ZILLOW GROUP INC - C	10,672	35.310	376,828.32
ACCENTURE PLC-CL A	40,416	287.980	11,638,999.68
ADOBE INC	30,205	326.780	9,870,389.90
AFFIRM HOLDINGS INC	9,077	12.810	116,276.37
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	10,300	91.030	937,609.00
ANSYS INC	5,908	240.630	1,421,642.04
APPLOVIN CORP-CLASS A	8,926	13.440	119,965.44
AUTODESK INC	13,358	195.180	2,607,214.44
AUTOMATIC DATA PROCESSING	26,947	257.060	6,926,995.82
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	11,682	37.500	438,075.00
BILL.COM HOLDINGS INC	6,004	114.670	688,478.68
BLACK KNIGHT INC	10,656	60.750	647,352.00
BLOCK INC	31,499	62.110	1,956,402.89
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	7,244	142.820	1,034,588.08
CADENCE DESIGN SYS INC	17,492	163.520	2,860,291.84
CERIDIAN HCM HOLDING INC	6,979	64.110	447,423.69
CHECK POINT SOFTWARE TECH	6,776	131.030	887,859.28
CLOUDFLARE INC - CLASS A	14,179	44.610	632,525.19
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	32,759	59.620	1,953,091.58
COUPA SOFTWARE INC	3,490	61.460	214,495.40
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	13,021	138.000	1,796,898.00
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,300	150.890	347,047.00
DATADOG INC - CLASS A	14,023	72.060	1,010,497.38
DOCUSIGN INC	12,031	44.560	536,101.36
DROPBOX INC-CLASS A	16,584	22.540	373,803.36
DYNATRACE INC	9,587	36.390	348,870.93
EPAM SYSTEMS INC	3,733	343.940	1,283,928.02
FAIR ISAAC CORP	1,494	590.740	882,565.56
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	38,249	67.530	2,582,954.97
FISERV INC	37,974	101.520	3,855,120.48
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,371	190.200	831,364.20
FORTINET INC	43,392	51.590	2,238,593.28
GARTNER INC	5,357	340.080	1,821,808.56
GEN DIGITAL INC	41,779	22.620	945,040.98
GLOBAL PAYMENTS INC	18,157	99.830	1,812,613.31
GODADDY INC - CLASS A	8,905	75.070	668,498.35
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	4,731	56.920	269,288.52
HUBSPOT INC	2,561	282.680	723,943.48
INTL BUSINESS MACHINES CORP	56,397	146.490	8,261,596.53
INTUIT INC	17,198	379.710	6,530,252.58
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,971	185.900	924,108.90
MASTERCARD INC - A	54,961	343.130	18,858,767.93
MICROSOFT CORP	450,054	240.330	108,161,477.82

MONGODB INC	4,150	142.300	590,545.00
OKTA INC	10,337	51.250	529,771.25
ORACLE CORP	100,364	80.850	8,114,429.40
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	98,735	7.080	699,043.80
PALO ALTO NETWORKS INC	18,642	170.510	3,178,647.42
PAYCHEX INC	20,831	120.150	2,502,844.65
PAYCOM SOFTWARE INC	3,007	321.980	968,193.86
PAYPAL HOLDINGS INC	70,771	77.640	5,494,660.44
PTC INC	7,295	123.070	897,795.65
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,992	35.090	140,079.28
ROPER TECHNOLOGIES INC	6,685	425.250	2,842,796.25
SALESFORCE INC	63,519	151.680	9,634,561.92
SERVICENOW INC	12,925	396.850	5,129,286.25
SNOWFLAKE INC-CLASS A	14,743	136.560	2,013,304.08
SPLUNK INC	9,792	75.890	743,114.88
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	14,487	51.630	747,963.81
SYNOPSYS INC	9,383	323.660	3,036,901.78
TWILIO INC - A	10,905	45.750	498,903.75
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,406	324.150	779,904.90
UNITY SOFTWARE INC	19,066	36.020	686,757.32
VERISIGN INC	6,425	194.960	1,252,618.00
VISA INC-CLASS A SHARES	104,154	209.060	21,774,435.24
VMWARE INC-CLASS A	13,809	118.030	1,629,876.27
WESTERN UNION CO	21,840	14.470	316,024.80
WIX.COM LTD	3,194	84.550	270,052.70
WORKDAY INC-CLASS A	12,069	143.300	1,729,487.70
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	13,927	70.570	982,828.39
ZSCALER INC	4,551	134.850	613,702.35
AMPHENOL CORP-CL A	37,896	77.400	2,933,150.40
APPLE INC	1,024,949	141.170	144,692,050.33
ARISTA NETWORKS INC	14,847	133.710	1,985,192.37
ARROW ELECTRONICS INC	4,130	106.230	438,729.90
CDW CORP/DE	8,621	184.080	1,586,953.68
CISCO SYSTEMS INC	264,008	48.280	12,746,306.24
COGNEX CORP	8,698	47.750	415,329.50
CORNING INC	51,762	33.410	1,729,368.42
DELL TECHNOLOGIES -C	18,797	43.520	818,045.44
F5 INC	3,921	149.820	587,444.22
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	86,138	15.460	1,331,693.48
HP INC	69,711	28.880	2,013,253.68
JUNIPER NETWORKS INC	17,460	31.870	556,450.20
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	11,811	173.110	2,044,602.21
MOTOROLA SOLUTIONS INC	10,692	264.460	2,827,606.32
NETAPP INC	13,273	71.790	952,868.67

SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	11,800	51.450	607,110.00
TE CONNECTIVITY LTD	19,805	123.940	2,454,631.70
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,844	408.780	1,162,570.32
TRIMBLE INC	15,566	56.390	877,766.74
WESTERN DIGITAL CORP	18,492	36.030	666,266.76
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	3,257	266.820	869,032.74
ADVANCED MICRO DEVICES	101,383	73.390	7,440,498.37
ANALOG DEVICES INC	33,495	163.890	5,489,495.55
APPLIED MATERIALS INC	53,908	103.250	5,566,001.00
BROADCOM INC	25,742	521.390	13,421,621.38
ENPHASE ENERGY INC	8,302	303.390	2,518,743.78
ENTEGRIS INC	9,961	72.390	721,076.79
INTEL CORP	261,839	28.900	7,567,147.10
KLA CORP	9,474	374.330	3,546,402.42
LAM RESEARCH CORP	8,550	442.050	3,779,527.50
MARVELL TECHNOLOGY INC	53,345	42.910	2,289,033.95
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	36,442	74.220	2,704,725.24
MICRON TECHNOLOGY INC	72,206	55.120	3,979,994.72
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,887	354.950	1,024,740.65
NVIDIA CORP	158,898	156.390	24,850,058.22
NXP SEMICONDUCTORS NV	16,594	164.690	2,732,865.86
ON SEMICONDUCTOR	27,891	70.720	1,972,451.52
QORVO INC	6,042	93.980	567,827.16
QUALCOMM INC	71,690	118.380	8,486,662.20
SKYWORKS SOLUTIONS INC	10,677	90.270	963,812.79
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	3,319	290.850	965,331.15
TERADYNE INC	10,642	89.190	949,159.98
TEXAS INSTRUMENTS INC	58,890	172.980	10,186,792.20
AT&T INC	457,781	19.010	8,702,416.81
LIBERTY GLOBAL PLC- C	21,079	20.460	431,276.34
LIBERTY GLOBAL PLC-A	8,432	19.720	166,279.04
LUMEN TECHNOLOGIES INC	49,758	5.470	272,176.26
T-MOBILE US INC	39,441	148.620	5,861,721.42
VERIZON COMMUNICATIONS INC	267,177	38.340	10,243,566.18
AES CORP	41,893	28.260	1,183,896.18
ALLIANT ENERGY CORP	16,641	55.070	916,419.87
AMEREN CORPORATION	16,937	87.240	1,477,583.88
AMERICAN ELECTRIC POWER	31,824	94.650	3,012,141.60
AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,721	147.140	1,724,627.94
ATMOS ENERGY CORP	8,726	118.640	1,035,252.64
CENTERPOINT ENERGY INC	37,091	30.580	1,134,242.78
CMS ENERGY CORP	16,996	60.200	1,023,159.20
CONSOLIDATED EDISON INC	22,160	96.300	2,134,008.00
CONSTELLATION ENERGY	20,234	94.430	1,910,696.62

DOMINION ENERGY INC	52,610	59.770	3,144,499.70
DTE ENERGY COMPANY	12,057	114.130	1,376,065.41
DUKE ENERGY CORP	49,646	97.940	4,862,329.24
EDISON INTERNATIONAL	24,655	63.510	1,565,839.05
ENTERGY CORP	12,677	112.810	1,430,092.37
ESSENTIAL UTILITIES INC	13,909	47.050	654,418.45
EVERGY INC	13,333	58.070	774,247.31
EVERSOURCE ENERGY	22,116	80.650	1,783,655.40
EXELON CORP	64,353	40.000	2,574,120.00
FIRSTENERGY CORP	31,966	39.800	1,272,246.80
NEXTERA ENERGY INC	125,422	82.490	10,346,060.78
NISOURCE INC	25,829	27.230	703,323.67
NRG ENERGY INC	13,547	41.910	567,754.77
P G & E CORP	91,894	15.170	1,394,031.98
PPL CORP	47,199	29.020	1,369,714.98
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	33,085	58.290	1,928,524.65
SEMPRA ENERGY	19,900	161.320	3,210,268.00
SOUTHERN CO/THE	68,572	65.730	4,507,237.56
UGI CORP	15,256	37.840	577,287.04
VISTRA CORP	25,777	24.230	624,576.71
WEC ENERGY GROUP INC	19,774	96.980	1,917,682.52
XCEL ENERGY INC	33,565	68.850	2,310,950.25
ACTIVISION BLIZZARD INC	50,681	74.340	3,767,625.54
ALPHABET INC-CL A	380,693	95.190	36,238,166.67
ALPHABET INC-CL C	356,993	95.440	34,071,411.92
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	27,658	7.430	205,498.94
AMC ENTERTAINMENT-PFD EQ UT	27,658	1.050	29,040.90
CABLE ONE INC	388	719.970	279,348.36
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,256	385.280	2,795,591.68
COMCAST CORP-CLASS A	279,670	35.480	9,922,691.60
DISH NETWORK CORP-A	12,937	15.680	202,852.16
ELECTRONIC ARTS INC	18,378	127.590	2,344,849.02
FOX CORP - CLASS A	16,962	31.720	538,034.64
FOX CORP - CLASS B	8,773	29.940	262,663.62
IAC INC	3,974	48.590	193,096.66
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	26,027	34.310	892,986.37
LIBERTY BROADBAND-C	8,196	89.430	732,968.28
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	13,438	59.140	794,723.32
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	4,141	43.070	178,352.87
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	12,383	42.890	531,106.87
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	11,080	70.210	777,926.80
MATCH GROUP INC	17,799	46.880	834,417.12
META PLATFORMS INC-CLASS A	145,152	109.460	15,888,337.92
NETFLIX INC	28,448	280.960	7,992,750.08

	NEWS CORP - CLASS A	23,102	18.560	428,773.12	
	OMNICOM GROUP	12,545	78.760	988,044.20	
	PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	40,964	19.750	809,039.00	
	PINTEREST INC- CLASS A	38,300	24.000	919,200.00	
	ROBLOX CORP -CLASS A	22,745	29.830	678,483.35	
	ROKU INC	6,012	54.180	325,730.16	
	SEA LTD-ADR	24,719	54.260	1,341,252.94	
	SIRIUS XM HOLDINGS INC	56,550	6.410	362,485.50	
	SNAP INC - A	64,099	9.820	629,452.18	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	10,772	101.350	1,091,742.20	
	TRADE DESK INC/THE -CLASS A	28,906	48.690	1,407,433.14	
	WALT DISNEY CO/THE	116,143	94.690	10,997,580.67	
	WARNER BROS DISCOVERY INC	136,145	11.140	1,516,655.30	
	ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	15,382	26.530	408,084.46	
	アメリカ・ドル小計	21,560,630		2,163,247,911.88 (300,410,237,523)	
カナダ・ドル	ARC RESOURCES LTD	44,923	19.370	870,158.51	
	CAMECO CORP	26,627	31.650	842,744.55	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	72,331	80.710	5,837,835.01	
	CENOVUS ENERGY INC	85,669	27.680	2,371,317.92	
	ENBRIDGE INC	127,550	55.520	7,081,576.00	
	IMPERIAL OIL LTD	16,267	77.980	1,268,500.66	
	KEYERA CORP	11,374	30.410	345,883.34	
	PARKLAND CORP	7,666	28.000	214,648.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	37,348	48.320	1,804,655.36	
	SUNCOR ENERGY INC	93,293	45.430	4,238,300.99	
	TC ENERGY CORP	61,897	61.260	3,791,810.22	
	TOURMALINE OIL CORP	20,401	81.100	1,654,521.10	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	27,243	67.760	1,845,985.68	
	BARRICK GOLD CORP	114,792	21.580	2,477,211.36	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	8,705	64.230	559,122.15	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	41,452	31.320	1,298,276.64	
	FRANCO-NEVADA CORP	12,789	192.780	2,465,463.42	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	32,698	11.460	374,719.08	
	KINROSS GOLD CORP	63,501	5.470	347,350.47	
	LUNDIN MINING CORP	46,446	8.240	382,715.04	
	NUTRIEN LTD	34,081	110.870	3,778,560.47	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	11,763	20.740	243,964.62	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	29,836	48.010	1,432,426.36	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,438	108.190	480,147.22	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	31,091	51.260	1,593,724.66		
CAE INC	17,963	28.700	515,538.10		
TOROMONT INDUSTRIES LTD	6,027	101.810	613,608.87		
WSP GLOBAL INC	7,668	160.150	1,228,030.20		

GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	9,913	38.220	378,874.86
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	7,930	72.370	573,894.10
THOMSON REUTERS CORP	11,370	154.200	1,753,254.00
AIR CANADA	12,083	18.920	228,610.36
CANADIAN NATL RAILWAY CO	36,438	169.990	6,194,095.62
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	58,152	108.920	6,333,915.84
TFI INTERNATIONAL INC	5,097	141.940	723,468.18
MAGNA INTERNATIONAL INC	18,921	81.840	1,548,494.64
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,082	97.110	299,293.02
GILDAN ACTIVEWEAR INC	11,302	38.170	431,397.34
RESTAURANT BRANDS INTERN	19,270	88.290	1,701,348.30
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	3,001	148.900	446,848.90
DOLLARAMA INC	17,025	81.440	1,386,516.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	52,906	61.250	3,240,492.50
EMPIRE CO LTD 'A'	9,148	36.580	334,633.84
LOBLAW COMPANIES LTD	11,573	121.260	1,403,341.98
METRO INC/CN	14,765	77.850	1,149,455.25
WESTON (GEORGE) LTD	4,984	169.860	846,582.24
SAPUTO INC	13,425	32.260	433,090.50
BANK OF MONTREAL	42,503	130.540	5,548,341.62
BANK OF NOVA SCOTIA	74,287	69.670	5,175,575.29
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	58,941	64.190	3,783,422.79
NATIONAL BANK OF CANADA	22,533	98.420	2,217,697.86
ROYAL BANK OF CANADA	90,561	133.770	12,114,344.97
TORONTO-DOMINION BANK	116,432	89.590	10,431,142.88
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	88,140	61.060	5,381,828.40
IGM FINANCIAL INC	4,949	38.810	192,070.69
ONEX CORPORATION	4,217	68.840	290,298.28
TMX GROUP LTD	3,142	138.200	434,224.40
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,393	786.000	1,094,898.00
GREAT-WEST LIFECO INC	14,200	32.040	454,968.00
IA FINANCIAL CORP INC	8,268	75.540	624,564.72
INTACT FINANCIAL CORP	11,416	199.300	2,275,208.80
MANULIFE FINANCIAL CORP	121,416	23.950	2,907,913.20
POWER CORP OF CANADA	31,768	33.480	1,063,592.64
SUN LIFE FINANCIAL INC	37,083	62.670	2,323,991.61
FIRSTSERVICE CORP	2,516	169.680	426,914.88
BLACKBERRY LTD	48,654	6.550	318,683.70
CGI INC	13,476	115.630	1,558,229.88
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,338	2,109.030	2,821,882.14
LIGHTSPEED COMMERCE INC	6,363	20.790	132,286.77
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	5,042	38.810	195,680.02
OPEN TEXT CORP	15,337	39.410	604,431.17
SHOPIFY INC - CLASS A	70,950	50.450	3,579,427.50

	BCE INC	5,509	64.010	352,631.09	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	22,595	61.380	1,386,881.10	
	TELUS CORP	15,222	28.560	434,740.32	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	44,154	9.910	437,566.14	
	ALTAGAS LTD	17,347	22.420	388,919.74	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	6,336	42.620	270,040.32	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	7,344	36.320	266,734.08	
	EMERA INC	18,000	51.580	928,440.00	
	FORTIS INC	30,171	53.450	1,612,639.95	
	HYDRO ONE LTD	18,821	36.610	689,036.81	
	NORTHLAND POWER INC	15,741	37.640	592,491.24	
	QUEBECOR INC -CL B	14,578	28.930	421,741.54	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	31,175	36.720	1,144,746.00	
	カナダ・ドル小計	2,558,142		154,244,632.01 (15,757,631,606)	
オーストラ リア・ドル	AMPOL LTD	14,428	28.510	411,342.28	
	SANTOS LTD	213,811	7.330	1,567,234.63	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,722	27.890	354,816.58	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	119,490	36.830	4,400,816.70	
	BHP GROUP LTD	323,691	44.820	14,507,830.62	
	BLUESCOPE STEEL LTD	37,214	17.110	636,731.54	
	EVOLUTION MINING LTD	84,420	2.670	225,401.40	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	105,200	19.460	2,047,192.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	26,108	29.400	767,575.20	
	MINERAL RESOURCES LTD	11,662	83.770	976,925.74	
	NEWCREST MINING LTD	54,082	19.630	1,061,629.66	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	65,844	10.540	693,995.76	
	ORICA LTD	36,212	14.970	542,093.64	
	RIO TINTO LTD	22,751	107.830	2,453,240.33	
	SOUTH32 LTD	276,348	4.070	1,124,736.36	
	REECE LTD	13,059	15.500	202,414.50	
	BRAMBLES LTD	86,089	12.020	1,034,789.78	
	AURIZON HOLDINGS LTD	130,251	3.740	487,138.74	
	QANTAS AIRWAYS LTD	78,226	6.190	484,218.94	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	37,719	35.450	1,337,138.55	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,794	65.600	248,886.40	
	IDP EDUCATION LTD	10,940	29.450	322,183.00	
	LOTTERY CORP LTD/THE	139,785	4.560	637,419.60	
	WESFARMERS LTD	73,250	48.360	3,542,370.00	
COLES GROUP LTD	84,799	17.060	1,446,670.94		
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	89,318	7.040	628,798.72		
WOOLWORTHS GROUP LTD	74,760	34.990	2,615,852.40		
TREASURY WINE ESTATES LTD	45,684	13.660	624,043.44		
COCHLEAR LTD	4,095	211.420	865,764.90		

	RAMSAY HEALTH CARE LTD	10,781	65.440	705,508.64	
	SONIC HEALTHCARE LTD	31,126	31.680	986,071.68	
	CSL LTD	30,442	302.580	9,211,140.36	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	183,288	24.910	4,565,704.08	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	107,036	108.090	11,569,521.24	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	207,367	31.690	6,571,460.23	
	WESTPAC BANKING CORP	227,353	23.830	5,417,821.99	
	ASX LTD	11,180	69.330	775,109.40	
	MACQUARIE GROUP LTD	22,604	178.000	4,023,512.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	173,755	4.800	834,024.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	128,724	2.910	374,586.84	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	101,860	12.960	1,320,105.60	
	SUNCORP GROUP LTD	88,234	12.000	1,058,808.00	
	COMPUTERSHARE LTD	28,738	27.660	794,893.08	
	WISETECH GLOBAL LTD	10,621	55.570	590,208.97	
	XERO LTD	8,683	69.500	603,468.50	
	TELSTRA GROUP LTD	273,343	4.000	1,093,372.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	110,998	7.970	884,654.06	
	REA GROUP LTD	2,833	122.750	347,750.75	
	SEEK LTD	21,957	22.230	488,104.11	
	オーストラリア・ドル小計	4,056,675		98,465,077.88 (9,136,574,576)	
香港・ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	173,424	44.250	7,674,012.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	83,000	88.900	7,378,700.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	94,000	14.380	1,351,720.00	
	MTR CORP	84,500	37.250	3,147,625.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	70,000	15.240	1,066,800.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	149,000	45.650	6,801,850.00	
	SANDS CHINA LTD	142,400	19.880	2,830,912.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	117,000	13.520	1,581,840.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	89,600	21.300	1,908,480.00	
	WH GROUP LTD	561,000	4.500	2,524,500.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	247,000	24.950	6,162,650.00	
	HANG SENG BANK LTD	48,200	119.400	5,755,080.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	73,800	300.000	22,140,000.00	
	AIA GROUP LTD	763,200	76.200	58,155,840.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	126,924	47.150	5,984,466.60	
	ESR GROUP LTD	157,000	16.660	2,615,620.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	98,000	13.460	1,319,080.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	83,384	24.300	2,026,231.20	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	84,833	18.520	1,571,107.16	
	SINO LAND CO	248,200	9.990	2,479,518.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	89,000	92.700	8,250,300.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	27,000	60.200	1,625,400.00	

	SWIRE PROPERTIES LTD	53,000	17.580	931,740.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	125,000	36.050	4,506,250.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	41,000	38.900	1,594,900.00	
	CLP HOLDINGS LTD	94,100	56.500	5,316,650.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	722,389	6.600	4,767,767.40	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	91,500	40.000	3,660,000.00	
	香港・ドル小計	4,737,454		175,129,039.36 (3,113,794,320)	
シンガポール・ドル	KEPPEL CORP LTD	94,400	7.530	710,832.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	108,600	3.490	379,014.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	77,966	5.470	426,474.02	
	GENTING SINGAPORE LTD	327,500	0.875	286,562.50	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	130,000	4.090	531,700.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	109,800	34.950	3,837,510.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	211,400	12.370	2,615,018.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	75,600	30.800	2,328,480.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	65,200	9.140	595,928.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	176,200	3.670	646,654.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	25,800	8.260	213,108.00	
	UOL GROUP LTD	30,900	6.490	200,541.00	
	VENTURE CORP LTD	21,700	17.300	375,410.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	480,715	2.730	1,312,351.95	
	シンガポール・ドル小計	1,935,781		14,459,583.47 (1,460,996,314)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	78,808	7.820	616,278.56	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,017	22.810	889,977.77	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	99,068	5.175	512,676.90	
	MERCURY NZ LTD	62,522	5.245	327,927.89	
	MERIDIAN ENERGY LTD	66,454	4.740	314,991.96	
	ニュージーランド・ドル小計	345,869		2,661,853.08 (229,265,406)	
イギリス・ポンド	BP PLC	1,222,797	4.920	6,016,161.24	
	SHELL PLC	472,935	24.005	11,352,804.67	
	ANGLO AMERICAN PLC	80,377	32.895	2,644,001.41	
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	13.640	265,147.96	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,838	67.120	526,086.56	
	GLENCORE PLC	622,741	5.508	3,430,057.42	
	JOHNSON MATTHEY PLC	10,074	21.370	215,281.38	
	MONDI PLC	33,905	15.560	527,561.80	
	RIO TINTO PLC	72,670	55.630	4,042,632.10	
	ASHTREAD GROUP PLC	26,131	49.910	1,304,198.21	
	BAE SYSTEMS PLC	209,260	8.104	1,695,843.04	
	BUNZL PLC	22,658	30.660	694,694.28	
	DCC PLC	5,954	44.750	266,441.50	
	FERGUSON PLC	13,361	94.900	1,267,958.90	

MELROSE INDUSTRIES PLC	305,227	1.314	401,068.27
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	494,144	0.891	440,282.30
SMITHS GROUP PLC	24,369	15.960	388,929.24
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	4,459	112.100	499,853.90
EXPERIAN PLC	54,749	28.690	1,570,748.81
INTERTEK GROUP PLC	11,884	39.440	468,704.96
RELX PLC	121,421	22.900	2,780,540.90
RENTOKIL INITIAL PLC	156,848	5.356	840,077.88
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,766	3.981	257,833.44
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,637	37.830	251,077.71
BURBERRY GROUP PLC	26,233	21.400	561,386.20
PERSIMMON PLC	16,916	12.700	214,833.20
TAYLOR WIMPEY PLC	225,588	1.021	230,325.34
COMPASS GROUP PLC	110,016	18.305	2,013,842.88
ENTAIN PLC	42,158	13.975	589,158.05
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	11,820	47.450	560,859.00
WHITBREAD PLC	11,282	25.860	291,752.52
JD SPORTS FASHION PLC	144,300	1.244	179,509.20
KINGFISHER PLC	109,678	2.408	264,104.62
NEXT PLC	9,030	57.400	518,322.00
OCADO GROUP PLC	27,379	6.170	168,928.43
SAINSBURY (J) PLC	113,480	2.231	253,173.88
TESCO PLC	495,919	2.330	1,155,491.27
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	24,258	15.850	384,489.30
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	138,571	33.505	4,642,821.35
COCA-COLA HBC AG-DI	8,704	20.180	175,646.72
DIAGEO PLC	145,740	37.680	5,491,483.20
IMPERIAL BRANDS PLC	59,422	21.230	1,261,529.06
HALEON PLC	293,573	2.853	837,563.76
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	44,920	59.400	2,668,248.00
UNILEVER PLC	163,379	41.245	6,738,566.85
NMC HEALTH PLC	3,940	0.010	39.40
SMITH & NEPHEW PLC	57,278	10.780	617,456.84
ASTRAZENECA PLC	98,093	110.600	10,849,085.80
GSK PLC	257,403	14.178	3,649,459.73
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	14,590	14.965	218,339.35
BARCLAYS PLC	1,083,154	1.610	1,743,877.94
HSBC HOLDINGS PLC	1,255,233	5.103	6,405,453.99
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,324,726	0.463	2,002,348.13
NATWEST GROUP PLC	347,420	2.605	905,029.10
STANDARD CHARTERED PLC	151,895	6.090	925,040.55
3I GROUP PLC	60,807	13.405	815,117.83
ABRDN PLC	138,015	2.052	283,206.78
HARGREAVES LANSDOWN PLC	31,008	8.506	263,754.04

	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	21,345	80.440	1,716,991.80	
	M&G PLC	119,733	1.922	230,126.82	
	SCHRODERS PLC	61,711	4.508	278,193.18	
	ST JAMES'S PLACE PLC	33,823	11.535	390,148.30	
	ADMIRAL GROUP PLC	11,535	20.270	233,814.45	
	AVIVA PLC	174,060	4.486	780,833.16	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	386,391	2.544	982,978.70	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	59,286	5.960	353,344.56	
	PRUDENTIAL PLC	178,081	9.648	1,718,125.48	
	AVEVA GROUP PLC	6,037	31.760	191,735.12	
	SAGE GROUP PLC/THE	75,045	7.860	589,853.70	
	HALMA PLC	24,375	21.280	518,700.00	
	BT GROUP PLC	403,957	1.228	496,059.19	
	VODAFONE GROUP PLC	1,639,544	0.918	1,505,101.39	
	NATIONAL GRID PLC	224,329	10.085	2,262,357.96	
	SEVERN TRENT PLC	14,904	27.140	404,494.56	
	SSE PLC	70,532	16.760	1,182,116.32	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	42,035	10.260	431,279.10	
	AUTO TRADER GROUP PLC	51,319	5.648	289,849.71	
	INFORMA PLC	102,755	6.104	627,216.52	
	PEARSON PLC	39,623	9.840	389,890.32	
	WPP PLC	78,503	8.684	681,720.05	
	イギリス・ポンド小計	17,929,495		116,283,162.58 (19,329,750,117)	
イスラエル・シュケ ル	ICL GROUP LTD	41,773	28.580	1,193,872.34	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,389	578.400	803,397.60	
	BANK HAPOLIM BM	84,682	32.990	2,793,659.18	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	92,639	31.480	2,916,275.72	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	85,339	20.450	1,745,182.55	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	9,249	126.900	1,173,698.10	
	AZRIELI GROUP LTD	2,140	243.000	520,020.00	
	NICE LTD	3,919	650.900	2,550,877.10	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	7,438	151.500	1,126,857.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	179,569	6.255	1,123,204.09	
	イスラエル・シュケル小計	508,137		15,947,043.68 (643,208,060)	
スイス・フ ラン	CLARIANT AG-REG	10,101	15.590	157,474.59	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	356	645.500	229,798.00	
	GIVAUDAN-REG	568	3,126.000	1,775,568.00	
	HOLCIM LTD	35,246	48.930	1,724,586.78	
	SIG GROUP AG	22,269	20.060	446,716.14	
	SIKA AG-REG	9,291	232.800	2,162,944.80	
	ABB LTD-REG	103,720	29.430	3,052,479.60	
	GEBERIT AG-REG	2,322	445.600	1,034,683.20	

SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,766	170.800	301,632.80		
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,030	179.300	543,279.00		
VAT GROUP AG	1,436	257.800	370,200.80		
ADECCO GROUP AG-REG	9,118	32.430	295,696.74		
SGS SA-REG	374	2,185.000	817,190.00		
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	3,570	225.200	803,964.00		
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	32,770	119.950	3,930,761.50		
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,716	245.500	421,278.00		
SWATCH GROUP AG/THE-REG	5,225	45.740	238,991.50		
BARRY CALLEBAUT AG-REG	216	1,920.000	414,720.00		
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	72	9,760.000	702,720.00		
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	6	97,400.000	584,400.00		
NESTLE SA-REG	178,946	111.260	19,909,531.96		
ALCON INC	31,165	64.160	1,999,546.40		
SONOVA HOLDING AG-REG	3,269	241.800	790,444.20		
STRAUMANN HOLDING AG-REG	7,044	105.500	743,142.00		
BACHEM HOLDING AG	1,756	87.700	154,001.20		
LONZA GROUP AG-REG	4,715	486.300	2,292,904.50		
NOVARTIS AG-REG	137,972	83.300	11,493,067.60		
ROCHE HOLDING AG-BR	1,740	372.800	648,672.00		
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	44,508	309.250	13,764,099.00		
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	168,196	2.902	488,104.79		
CREDIT SUISSE GROUP AG-RTS	168,196	0.099	16,651.40		
JULIUS BAER GROUP LTD	15,168	53.940	818,161.92		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,372	908.400	1,246,324.80		
UBS GROUP AG-REG	221,255	17.350	3,838,774.25		
BALOISE HOLDING AG - REG	2,475	142.300	352,192.50		
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,834	503.000	922,502.00		
SWISS RE AG	19,228	84.520	1,625,150.56		
ZURICH INSURANCE GROUP AG	9,713	452.000	4,390,276.00		
SWISS PRIME SITE-REG	5,572	78.300	436,287.60		
TEMENOS AG - REG	3,743	57.300	214,473.90		
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	10,426	55.480	578,434.48		
SWISSCOM AG-REG	1,709	504.800	862,703.20		
スイス・フラン小計	1,283,174		87,594,531.71 (12,759,895,434)		
デンマーク・クローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	7,211	435.800	3,142,553.80	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	14,003	409.900	5,739,829.70	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	513	1,575.000	807,975.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	65,433	176.080	11,521,442.64	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	206	14,690.000	3,026,140.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	311	15,085.000	4,691,435.00	
	DSV A/S	11,417	1,106.500	12,632,910.50	
	PANDORA A/S	5,888	503.800	2,966,374.40	

	CARLSBERG AS-B	5,585	903.800	5,047,723.00	
	COLOPLAST-B	8,316	863.400	7,180,034.40	
	DEMANT A/S	8,178	200.600	1,640,506.80	
	GN STORE NORD A/S	6,484	168.300	1,091,257.20	
	GENMAB A/S	3,934	3,180.000	12,510,120.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	104,880	879.900	92,283,912.00	
	DANSKE BANK A/S	39,103	127.150	4,971,946.45	
	TRYG A/S	24,975	164.550	4,109,636.25	
	ORSTED A/S	12,090	604.200	7,304,778.00	
	デンマーク・クローネ小計	318,527		180,668,575.14 (3,488,710,186)	
ノル ウェー・ク ローネ	AKER BP ASA	21,204	339.600	7,200,878.40	
	EQUINOR ASA	60,849	377.000	22,940,073.00	
	NORSK HYDRO ASA	87,753	73.080	6,412,989.24	
	YARA INTERNATIONAL ASA	10,872	465.300	5,058,741.60	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	6,526	400.000	2,610,400.00	
	MOWI ASA	23,318	153.650	3,582,810.70	
	ORKLA ASA	46,955	69.380	3,257,737.90	
	SALMAR ASA	4,188	332.800	1,393,766.40	
	DNB BANK ASA	61,691	190.800	11,770,642.80	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,412	187.600	2,140,891.20	
	TELENOR ASA	40,694	97.920	3,984,756.48	
ADEVINTA ASA	15,540	76.300	1,185,702.00		
	ノルウェー・クローネ小計	391,002		71,539,389.72 (994,397,517)	
スウェーデ ン・クロー ナ	BOLIDEN AB	15,297	380.500	5,820,508.50	
	HOLMEN AB-B SHARES	7,024	430.300	3,022,427.20	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	34,370	141.600	4,866,792.00	
	ALFA LAVAL AB	18,697	295.500	5,524,963.50	
	ASSA ABLOY AB-B	62,454	238.400	14,889,033.60	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	169,730	128.960	21,888,380.80	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	107,424	116.400	12,504,153.60	
	EPIROC AB-A	44,746	197.450	8,835,097.70	
	EPIROC AB-B	19,836	170.000	3,372,120.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	80.320	1,493,389.76	
	INDUTRADE AB	17,913	219.800	3,937,277.40	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,223	205.200	1,687,359.60	
	LIFCO AB-B SHS	15,149	176.800	2,678,343.20	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	89,271	97.860	8,736,060.06	
	SANDVIK AB	70,108	192.000	13,460,736.00	
	SKANSKA AB-B SHS	26,915	170.800	4,597,082.00	
SKF AB-B SHARES	20,607	173.100	3,567,071.70		
VOLVO AB-A SHS	13,283	201.400	2,675,196.20		
VOLVO AB-B SHS	90,883	190.680	17,329,570.44		

	SECURITAS AB-B SHS	41,010	88.280	3,620,362.80	
	VOLVO CAR AB-B	38,628	49.735	1,921,163.58	
	ELECTROLUX AB-B	11,555	145.580	1,682,176.90	
	EVOLUTION AB	11,254	1,043.400	11,742,423.60	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	52,210	117.620	6,140,940.20	
	SWEDISH MATCH AB	103,037	115.200	11,869,862.40	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	36,076	255.400	9,213,810.40	
	GETINGE AB-B SHS	13,151	238.500	3,136,513.50	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	13,513	219.100	2,960,698.30	
	NORDEA BANK ABP	210,076	109.860	23,078,949.36	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	108,374	119.550	12,956,111.70	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	97,603	104.300	10,179,992.90	
	SWEDBANK AB - A SHARES	57,603	167.450	9,645,622.35	
	EQT AB	23,194	236.000	5,473,784.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	7,211	265.000	1,910,915.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,642	263.700	2,806,295.40	
	INVESTOR AB-A SHS	27,415	198.550	5,443,248.25	
	INVESTOR AB-B SHS	111,744	191.420	21,390,036.48	
	KINNEVIK AB - B	12,465	158.650	1,977,572.25	
	LUNDBERGS AB-B SHS	6,081	468.000	2,845,908.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	31,938	46.890	1,497,572.82	
	SAGAX AB-B	14,721	222.900	3,281,310.90	
	ERICSSON LM-B SHS	183,318	64.480	11,820,344.64	
	HEXAGON AB-B SHS	117,010	117.900	13,795,479.00	
	TELE2 AB-B SHS	38,424	93.260	3,583,422.24	
	TELIA CO AB	187,675	28.850	5,414,423.75	
	EMBRACER GROUP AB	30,012	44.925	1,348,289.10	
	スウェーデン・クローナ小計	2,446,463		331,622,793.08 (4,357,523,501)	
ユーロ	ENI SPA	160,158	14.196	2,273,602.96	
	GALP ENERGIA SGPS SA	25,920	11.590	300,412.80	
	NESTE OYJ	26,563	46.690	1,240,226.47	
	OMV AG	8,389	49.580	415,926.62	
	REPSOL SA	96,457	14.635	1,411,648.19	
	TENARIS SA	25,963	16.380	425,273.94	
	TOTALENERGIES SE	158,113	58.940	9,319,180.22	
	AIR LIQUIDE SA	33,412	138.760	4,636,249.12	
	AKZO NOBEL N.V.	12,475	68.280	851,793.00	
	ARCELORMITTAL	37,054	25.940	961,180.76	
	ARKEMA	3,250	83.940	272,805.00	
	BASF SE	59,053	49.060	2,897,140.18	
	COVESTRO AG	11,797	38.230	450,999.31	
	CRH PLC	45,964	38.370	1,763,638.68	
	EVONIK INDUSTRIES AG	17,669	18.535	327,494.91	

HEIDELBERGCEMENT AG	8,677	52.480	455,368.96
KONINKLIJKE DSM NV	10,433	119.950	1,251,438.35
OCI NV	6,000	39.940	239,640.00
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	17,189	34.730	596,973.97
SOLVAY SA	4,802	94.140	452,060.28
STORA ENSO OYJ-R SHS	39,228	14.040	550,761.12
SYMRISE AG	8,404	107.650	904,690.60
UMICORE	13,160	34.220	450,335.20
UPM-KYMMENE OYJ	32,818	34.660	1,137,471.88
VOESTALPINE AG	7,382	26.200	193,408.40
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	13,189	26.830	353,860.87
AIRBUS SE	38,170	109.180	4,167,400.60
ALSTOM	17,665	24.560	433,852.40
BOUYGUES SA	17,123	29.720	508,895.56
BRENTAG SE	9,920	60.580	600,953.60
CNH INDUSTRIAL NV	68,766	15.200	1,045,243.20
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	29,471	44.180	1,302,028.78
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	29,358	30.960	908,923.68
DASSAULT AVIATION SA	1,720	151.200	260,064.00
EIFFAGE	4,989	94.440	471,161.16
FERROVIAL SA	32,177	25.530	821,478.81
GEA GROUP AG	8,178	38.900	318,124.20
IMCD NV	3,214	139.150	447,228.10
KINGSPAN GROUP PLC	9,597	54.040	518,621.88
KION GROUP AG	3,179	27.110	86,182.69
KNORR-BREMSE AG	3,881	54.000	209,574.00
KONE OYJ-B	20,623	48.500	1,000,215.50
LEGRAND SA	16,852	78.060	1,315,467.12
MTU AERO ENGINES AG	3,854	197.400	760,779.60
PRYSMIAN SPA	17,186	33.720	579,511.92
RATIONAL AG	350	582.500	203,875.00
RHEINMETALL AG	2,899	193.450	560,811.55
SAFRAN SA	21,782	116.500	2,537,603.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	34,868	138.880	4,842,467.84
SIEMENS AG-REG	48,890	133.080	6,506,281.20
SIEMENS ENERGY AG	31,878	15.670	499,528.26
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	19,773	18.010	356,111.73
THALES SA	7,074	121.850	861,966.90
VINCI SA	34,050	96.590	3,288,889.50
WARTSILA OYJ ABP	26,753	8.170	218,572.01
BUREAU VERITAS SA	17,817	25.170	448,453.89
RANDSTAD NV	8,946	55.740	498,650.04
TELEPERFORMANCE	3,420	214.000	731,880.00
WOLTERS KLUWER	16,360	104.300	1,706,348.00

ADP	1,346	145.700	196,112.20
AENA SME SA	4,377	121.350	531,148.95
ATLANTIA SPA	26,501	22.930	607,667.93
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	33,148	7.592	251,659.61
DEUTSCHE POST AG-REG	62,178	37.840	2,352,815.52
GETLINK SE	30,428	15.905	483,957.34
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	20,347	84.750	1,724,408.25
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	3,679	80.150	294,871.85
CONTINENTAL AG	8,078	57.880	467,554.64
DR ING HC F PORSCHE AG	7,000	106.450	745,150.00
FERRARI NV	7,986	208.500	1,665,081.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	52,242	62.540	3,267,214.68
MICHELIN (CGDE)	45,659	26.440	1,207,223.96
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	10,089	58.000	585,162.00
RENAULT SA	14,764	33.780	498,727.92
STELLANTIS NV	139,238	14.710	2,048,190.98
VALEO	14,444	17.630	254,647.72
VOLKSWAGEN AG	1,960	181.700	356,132.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	11,844	137.840	1,632,576.96
ADIDAS AG	10,395	120.940	1,257,171.30
HERMES INTERNATIONAL	1,973	1,484.000	2,927,932.00
KERING	4,759	552.600	2,629,823.40
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	17,700	702.000	12,425,400.00
MONCLER SPA	12,209	48.000	586,032.00
PUMA SE	6,459	47.850	309,063.15
SEB SA	1,127	76.800	86,553.60
ACCOR SA	10,451	24.880	260,020.88
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	11,019	138.650	1,527,784.35
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,785	37.410	216,416.85
SODEXO SA	4,760	91.040	433,350.40
DELIVERY HERO SE	8,530	39.380	335,911.40
D'IETTEREN GROUP	1,449	178.000	257,922.00
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	71,341	24.920	1,777,817.72
JUST EAT TAKEAWAY	12,903	20.940	270,188.82
PROSUS NV	51,027	60.270	3,075,397.29
ZALANDO SE	12,367	29.250	361,734.75
CARREFOUR SA	35,990	16.510	594,194.90
HELLOFRESH SE	9,790	22.660	221,841.40
JERONIMO MARTINS	17,393	21.340	371,166.62
KESKO OYJ-B SHS	20,250	20.530	415,732.50
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	64,661	27.940	1,806,628.34
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	56,632	56.200	3,182,718.40
DANONE	40,711	50.300	2,047,763.30
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	35,407	10.035	355,309.24

HEINEKEN HOLDING NV	6,168	72.500	447,180.00
HEINEKEN NV	16,091	88.700	1,427,271.70
JDE PEET'S NV	6,660	29.200	194,472.00
KERRY GROUP PLC-A	9,894	90.860	898,968.84
PERNOD RICARD SA	13,733	186.950	2,567,384.35
REMY COINTREAU	1,273	161.800	205,971.40
BEIERSDORF AG	6,813	102.950	701,398.35
HENKEL AG & CO KGAA	5,974	64.500	385,323.00
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	10,398	68.380	711,015.24
L'OREAL	15,195	347.500	5,280,262.50
AMPLIFON SPA	7,567	27.110	205,141.37
BIOMERIEUX	2,791	96.060	268,103.46
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,161	126.900	274,230.90
DIASORIN SPA	1,313	128.900	169,245.70
ESSILORLUXOTTICA	17,807	175.500	3,125,128.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	13,613	29.660	403,761.58
FRESENIUS SE & CO KGAA	23,254	26.270	610,882.58
KONINKLIJKE PHILIPS NV	52,727	14.080	742,396.16
SIEMENS HEALTHINEERS AG	16,426	50.440	828,527.44
ARGENX SE	3,503	364.300	1,276,142.90
BAYER AG-REG	63,781	55.960	3,569,184.76
EUROFINS SCIENTIFIC	9,270	67.040	621,460.80
GRIFOLS SA	15,169	9.944	150,840.53
IPSEN	1,498	108.800	162,982.40
MERCK KGAA	7,777	172.100	1,338,421.70
ORION OYJ-CLASS B	6,261	50.420	315,679.62
QIAGEN N.V.	15,665	47.180	739,074.70
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	8,068	40.010	322,800.68
SANOFI	73,053	88.190	6,442,544.07
SARTORIUS AG-VORZUG	1,682	353.400	594,418.80
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,555	315.700	490,913.50
UCB SA	7,782	77.140	600,303.48
ABN AMRO BANK NV-CVA	28,787	12.280	353,504.36
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	420,232	5.624	2,363,384.76
BANCO SANTANDER SA	1,046,474	2.835	2,966,753.79
BNP PARIBAS	72,020	53.570	3,858,111.40
CAIXABANK SA	290,777	3.548	1,031,676.79
COMMERZBANK AG	60,640	8.012	485,847.68
CREDIT AGRICOLE SA	73,102	9.606	702,217.81
ERSTE GROUP BANK AG	20,506	29.420	603,286.52
FINECOBANK SPA	43,093	15.120	651,566.16
ING GROEP NV	254,105	11.662	2,963,372.51
INTESA SANPAOLO	1,011,886	2.134	2,159,364.72
KBC GROUP NV	14,910	52.520	783,073.20

MEDIOBANCA SPA	47,708	9.256	441,585.24
SOCIETE GENERALE SA	48,558	24.075	1,169,033.85
UNICREDIT SPA	127,961	12.960	1,658,374.56
AMUNDI SA	3,955	52.600	208,033.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	127,233	10.210	1,299,048.93
DEUTSCHE BOERSE AG	11,916	172.500	2,055,510.00
EURAZEO SE	1,792	60.500	108,416.00
EURONEXT NV	5,502	71.780	394,933.56
EXOR NV	6,204	73.900	458,475.60
GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	5,914	77.060	455,732.84
SOFINA	804	211.000	169,644.00
WENDEL	1,082	87.050	94,188.10
AEGON NV	127,748	4.670	596,583.16
AGEAS	11,247	37.810	425,249.07
ALLIANZ SE-REG	26,307	205.600	5,408,719.20
ASSICURAZIONI GENERALI	72,382	16.940	1,226,151.08
AXA SA	119,547	27.355	3,270,208.18
HANNOVER RUECK SE	3,598	181.200	651,957.60
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	9,023	301.500	2,720,434.50
NN GROUP NV	16,917	40.330	682,262.61
POSTE ITALIANE SPA	34,720	9.422	327,131.84
SAMPO OYJ-A SHS	29,843	48.330	1,442,312.19
AROUNDTOWN SA	73,508	2.336	171,714.68
LEG IMMOBILIEN SE	4,538	61.560	279,359.28
VONOVIA SE	46,339	23.800	1,102,868.20
ADYEN NV	1,394	1,427.000	1,989,238.00
AMADEUS IT GROUP SA	29,928	50.860	1,522,138.08
BECHTLE AG	4,305	34.010	146,413.05
CAPGEMINI SE	10,453	172.750	1,805,755.75
DASSAULT SYSTEMES SE	40,049	34.755	1,391,902.99
EDENRED	14,650	52.620	770,883.00
NEMETSCHKE SE	3,011	45.650	137,452.15
NEXI SPA	30,853	8.340	257,314.02
SAP SE	66,988	103.080	6,905,123.04
WORLDLINE SA	16,677	44.810	747,296.37
NOKIA OYJ	348,610	4.571	1,593,496.31
ASM INTERNATIONAL NV	3,170	256.150	811,995.50
ASML HOLDING NV	25,752	559.800	14,415,969.60
INFINEON TECHNOLOGIES AG	79,641	30.600	2,437,014.60
STMICROELECTRONICS NV	43,538	35.750	1,556,483.50
CELLNEX TELECOM SA	32,830	32.610	1,070,586.30
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	208,285	19.464	4,054,059.24
ELISA OYJ	10,160	49.560	503,529.60
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,804	9.386	148,336.34

KONINKLIJKE KPN NV	222,179	2.911	646,763.06	
ORANGE	127,798	9.844	1,258,043.51	
PROXIMUS	10,895	10.155	110,638.72	
TELECOM ITALIA SPA	696,355	0.217	151,109.03	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	79,654	2.268	180,655.27	
TELEFONICA SA	335,910	3.590	1,205,916.90	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,269	19.140	100,848.66	
ACCIONA SA	1,810	181.300	328,153.00	
E.ON SE	147,318	9.086	1,338,531.34	
EDF	32,658	12.000	391,896.00	
EDP RENOVAVEIS SA	17,764	21.730	386,011.72	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	195,232	4.420	862,925.44	
ELIA GROUP SA/NV	2,111	134.200	283,296.20	
ENAGAS SA	14,471	17.300	250,348.30	
ENDESA SA	14,104	17.545	247,454.68	
ENEL SPA	501,060	5.106	2,558,412.36	
ENGIE	117,899	14.360	1,693,029.64	
FORTUM OYJ	24,312	15.020	365,166.24	
IBERDROLA SA	376,863	10.655	4,015,475.26	
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,603	26.220	278,010.66	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	23,632	16.985	401,389.52	
RWE AG	38,604	41.740	1,611,330.96	
SNAM SPA	133,867	4.797	642,159.99	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA	101,686	7.198	731,935.82	
UNIPER SE	4,697	4.788	22,489.23	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	42,162	24.320	1,025,379.84	
VERBUND AG	5,346	85.700	458,152.20	
BOLLORE SE	69,288	5.235	362,722.68	
PUBLICIS GROUPE	13,301	63.000	837,963.00	
SCOUT24 SE	4,671	51.100	238,688.10	
UBISOFT ENTERTAINMENT	4,745	26.200	124,319.00	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	44,422	22.250	988,389.50	
VIVENDI SE	38,496	8.550	329,140.80	
ユーロ小計	11,705,778		278,558,159.68 (39,995,380,567)	
合計	69,777,127		411,677,365,126 (411,677,365,126)	

(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	597銘柄	67.9%	73.0%
カナダ・ドル	株式	85銘柄	3.6%	3.8%
オーストラリア・ドル	株式	49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%	0.4%

ニュージーランド・ドル	株式	5銘柄	0.1%	0.1%
イギリス・ポンド	株式	80銘柄	4.4%	4.7%
イスラエル・シケル	株式	10銘柄	0.1%	0.2%
スイス・フラン	株式	42銘柄	2.9%	3.1%
デンマーク・クローネ	株式	17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	46銘柄	1.0%	1.1%
ユーロ	株式	224銘柄	9.0%	9.7%

(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	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9,773.00	1,490,577.96	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	20,093.00	653,223.43	
		AMERICAN TOWER CORP	28,877.00	6,272,661.94	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	22,502.00	477,267.42	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	9,096.00	1,553,505.84	
		BOSTON PROPERTIES INC	9,604.00	678,906.76	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,009.00	707,559.75	
		CROWN CASTLE INC	27,033.00	3,760,560.63	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	18,137.00	1,972,398.75	
		EQUINIX INC	5,902.00	3,960,005.92	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	11,186.00	731,899.98	
		EQUITY RESIDENTIAL	22,609.00	1,437,480.22	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,379.00	939,251.71	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	8,530.00	1,309,525.60	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	17,613.00	908,302.41	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	22,843.00	455,260.99	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	36,377.00	932,706.28	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	46,189.00	861,886.74	
		INVITATION HOMES INC	36,871.00	1,176,922.32	
		IRON MOUNTAIN INC	19,659.00	1,058,833.74	
		KIMCO REALTY CORP	35,169.00	799,039.68	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	31,858.00	413,516.84	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	7,866.00	1,273,662.72	
		PROLOGIS INC	59,103.00	6,726,512.43	
		PUBLIC STORAGE	10,308.00	2,995,504.80	
		REALTY INCOME CORP	36,686.00	2,285,537.80	
		REGENCY CENTERS CORP	9,608.00	632,398.56	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	7,141.00	2,103,381.55	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	20,565.00	2,415,564.90	
		SUN COMMUNITIES INC	7,129.00	1,032,350.49	
UDR INC	20,610.00	839,857.50			
VENTAS INC	23,363.00	1,060,680.20			
VICI PROPERTIES INC	60,354.00	2,032,119.18			

	VORNADO REALTY TRUST	8,706.00	220,348.86	
	WELLTOWER INC	27,308.00	1,889,713.60	
	WEYERHAEUSER CO	47,220.00	1,499,707.20	
	WP CAREY INC	11,067.00	865,660.74	
	アメリカ・ドル小計	807,343.00	60,424,295.44 (8,391,121,908)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,170.00	353,761.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,441.00	158,270.07	
	カナダ・ドル小計	15,611.00	512,031.07 (52,309,094)	
オーストラリア・ドル	APA GROUP	75,718.00	850,313.14	
	DEXUS/AU	79,604.00	625,687.44	
	GOODMAN GROUP	106,251.00	1,985,831.19	
	GPT GROUP	121,221.00	529,735.77	
	LENLEASE GROUP	36,263.00	276,324.06	
	MIRVAC GROUP	251,619.00	558,594.18	
	SCENTRE GROUP	350,311.00	1,029,914.34	
	STOCKLAND	127,393.00	484,093.40	
	TRANSURBAN GROUP	190,071.00	2,697,107.49	
	VICINITY CENTRES	241,241.00	489,719.23	
	オーストラリア・ドル小計	1,579,692.00	9,527,320.24 (884,040,045)	
香港・ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	193,500.00	1,075,860.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	276,000.00	2,586,120.00	
	LINK REIT	136,600.00	7,185,160.00	
	香港・ドル小計	606,100.00	10,847,140.00 (192,862,149)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	219,000.00	604,440.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	303,516.00	631,313.28	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	208,100.00	335,041.00	
	MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	112,400.00	194,452.00	
	シンガポール・ドル小計	843,016.00	1,765,246.28 (178,360,484)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	49,008.00	198,335.37	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	39,861.00	247,377.36	
	SEGRO PLC	78,831.00	637,269.80	
	イギリス・ポンド小計	167,700.00	1,082,982.53 (180,024,186)	
ユーロ	COVIVIO	2,388.00	134,563.80	
	GECINA SA	3,082.00	292,019.50	
	KLEPIERRE	13,600.00	303,008.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	7,024.00	365,107.52	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	9,913.00	254,962.36	
	ユーロ小計	36,007.00	1,349,661.18 (193,784,352)	

投資証券合計		10,072,502,218	
		(10,072,502,218)	
合計		10,072,502,218	
		(10,072,502,218)	

(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 37銘柄	1.9%	83.3%
カナダ・ドル	投資証券 2銘柄	0.0%	0.5%
オーストラリア・ドル	投資証券 10銘柄	0.2%	8.8%
香港・ドル	投資証券 3銘柄	0.0%	1.9%
シンガポール・ドル	投資証券 4銘柄	0.0%	1.8%
イギリス・ポンド	投資証券 3銘柄	0.0%	1.8%
ユーロ	投資証券 5銘柄	0.0%	1.9%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2021年11月30日現在)	(2022年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	526,830,782	3,890,895,302
金銭信託	148,804,249	31,231,738
コール・ローン	4,388,726,863	192,702,578
株式	9,917,488,534	18,551,125,070
新株予約権証券	15,618	-
投資信託受益証券	609,236,472	1,080,935,590
投資証券	1,160,702,755	1,751,546,641
派生商品評価勘定	95,588,547	150,967,660
未収入金	81,341	-
未収配当金	6,023,917	34,213,350
差入委託証拠金	1,095,136,406	977,033,005
流動資産合計	17,948,635,484	26,660,650,934
資産合計	17,948,635,484	26,660,650,934
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	399,979,043	83,196,904
未払解約金	-	26,843,066
その他未払費用	19,220	543
流動負債合計	399,998,263	110,040,513

負債合計	399,998,263	110,040,513
純資産の部		
元本等		
元本	10,481,267,749	16,108,126,428
剰余金		
剰余金又は欠損金()	7,067,369,472	10,442,483,993
元本等合計	17,548,637,221	26,550,610,421
純資産合計	17,548,637,221	26,550,610,421
負債純資産合計	17,948,635,484	26,660,650,934

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、新株予約権証券、投資信託受益証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年11月30日現在)	(2022年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における 受益権の総数	10,481,267,749口	16,108,126,428口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.6743円 (1万口当たりの純資産額16,743円)	1口当たり純資産額 1.6483円 (1万口当たりの純資産額16,483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12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券、投資信託受益証券、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 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と、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11月30日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券（株式、投資信託受益証券、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11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

		契 約 額 等		
--	--	---------	--	--

区 分	種 類		時 価		評 価 損 益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MSCIE 2112	6,380,573,149	-	5,988,815,825	391,757,324
	小計	6,380,573,149	-	5,988,815,825	391,757,324
合 計		6,380,573,149	-	5,988,815,825	391,757,324

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち 1年超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	7,983,376,975	-	8,071,411,706	88,034,731
	小計	7,983,376,975	-	8,071,411,706	88,034,731
	売建				
	アメリカ・ドル	3,329,000,000	-	3,329,667,903	667,903
	小計	3,329,000,000	-	3,329,667,903	667,903
合 計		11,312,376,975	-	11,401,079,609	87,366,828

(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MSCI EMGMKT DEC22	5,203,165,884	-	5,271,112,198	67,946,314
	小計	5,203,165,884	-	5,271,112,198	67,946,314
合 計		5,203,165,884	-	5,271,112,198	67,946,314

(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	為替予約取引 買建				

の取引	アメリカ・ドル	262,300,000	-	262,124,442	175,558
	小計	262,300,000	-	262,124,442	175,558
	合 計	262,300,000	-	262,124,442	175,558

(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いません。

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。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2021年12月1日
至 2022年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2021年11月30日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	8,871,955,436円
同期中における追加設定元本額	1,737,420,987円
同期中における一部解約元本額	128,108,674円
2021年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	5,579,019,461円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	2,537,014,239円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	281,123,454円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	347,001,173円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	231,807,511円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	25,823,557円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	75,281,661円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	55,223,465円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	223,853,475円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	174,716,658円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	286,040,332円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	64,850,516円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	3,488,528円

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	188,448,982円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	358,795,181円
三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド	1,807,891円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	46,971,665円
合計	10,481,267,749円

(2022年11月30日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	10,481,267,749円
同期中における追加設定元本額	7,656,711,181円
同期中における一部解約元本額	2,029,852,502円
2022年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	8,414,992,973円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	2,960,029,922円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	183,852,090円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	291,047,771円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	194,328,149円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	40,006,969円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	100,172,461円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	75,036,325円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	334,887,158円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	274,169,234円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	448,887,023円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	103,796,383円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	5,268,543円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	706,099,778円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	1,907,693,075円
三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド	13,672,741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>	54,185,833円
合計	16,108,126,428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	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	26,200	1.500	39,300.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	4,068	8.010	32,584.68	
	SOUTHERN COPPER CORP	2,096	59.330	124,355.68	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	10,416	24.050	250,504.80	
	LI AUTO INC - ADR	13,478	18.530	249,747.34	
	NIO INC - ADR	33,895	10.500	355,897.50	
	XPENG INC - ADR	10,439	7.340	76,622.26	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	4,760	36.060	171,645.60	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	11,121	5.770	64,168.17	

	TRIP.COM GROUP LTD-ADR	13,447	29.200	392,652.40	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	10,389	53.430	555,084.27	
	PINDUODUO INC-ADR	12,466	78.430	977,708.38	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	10,692	10.090	107,882.28	
	RLX TECHNOLOGY INC-ADR	10,343	2.180	22,547.74	
	BEIGENE LTD-ADR	1,163	179.860	209,177.18	
	HUTCHMED CHINA-ADR	1,444	12.970	18,728.68	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	1,201	48.510	58,260.51	
	ZAI LAB LTD-ADR	2,172	33.690	73,174.68	
	CREDICORP LTD	1,764	146.930	259,184.52	
	360 DIGITECH INC	2,669	14.560	38,860.64	
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	18,837	1.610	30,327.57	
	KE HOLDINGS INC-ADR	16,424	15.110	248,166.64	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	27,780	0.808	22,446.24	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	12,430	3.072	38,184.96	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	1,469	50.760	74,566.44	
	AUTOHOME INC-ADR	2,090	28.140	58,812.60	
	IQIYI INC-ADR	7,166	2.700	19,348.20	
	JOYY INC-ADR	1,164	29.910	34,815.24	
	KANZHUN LTD - ADR	4,491	16.470	73,966.77	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	19,174	6.600	126,548.40	
	WEIBO CORP-SPON ADR	1,472	14.740	21,697.28	
	アメリカ・ドル小計	296,720		4,826,967.65 (670,320,998)	
香港・ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	51,000	6.960	354,960.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	38,000	9.710	368,980.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	646,000	3.580	2,312,680.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	83,500	23.100	1,928,850.00	
	CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	29,000	3.360	97,440.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	520,000	3.480	1,809,600.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	38,000	24.650	936,700.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	72,000	3.220	231,840.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	32,500	28.000	910,000.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	47,000	7.080	332,760.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	104,000	6.790	706,160.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	52,000	4.170	216,840.00	
	CMOC GROUP LTD-H	66,000	3.530	232,980.00	
	DONGYUE GROUP	43,000	8.360	359,480.00	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO L-H	8,400	63.700	535,080.00	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	20,000	11.040	220,800.00	
	MMG LTD	80,000	2.030	162,400.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	37,000	5.850	216,450.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	14,250	14.740	210,045.00		
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	33,000	8.490	280,170.00		

ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	142,000	10.000	1,420,000.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	51,000	3.550	181,050.00	
BOC AVIATION LTD	6,100	58.350	355,935.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	54,000	2.610	140,940.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	44,500	17.380	773,410.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	23,000	9.230	212,290.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	104,000	4.310	448,240.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	42,000	9.020	378,840.00	
CITIC LTD	143,000	7.790	1,113,970.00	
CRRC CORP LTD - H	85,000	3.100	263,500.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	72,000	5.810	418,320.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	13,000	18.840	244,920.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	19,000	8.090	153,710.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	10,000	9.700	97,000.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	46,000	9.830	452,180.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	16,218	8.390	136,069.02	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	13,500	35.050	473,175.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	29,800	3.750	111,750.00	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	77,000	3.350	257,950.00	
AIR CHINA LTD-H	56,000	5.950	333,200.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	44,000	4.700	206,800.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	38,140	11.200	427,168.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	40,000	4.400	176,000.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	78,400	7.960	624,064.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	38,000	5.880	223,440.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	22,000	6.370	140,140.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	3,000	138.400	415,200.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	27,000	7.050	190,350.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	32,000	5.770	184,640.00	
BYD CO LTD-H	20,500	182.000	3,731,000.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	70,000	4.150	290,500.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	16,800	33.350	560,280.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	148,000	10.260	1,518,480.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	81,500	10.340	842,710.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	81,200	5.300	430,360.00	
MINTH GROUP LTD	22,000	19.800	435,600.00	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	34,000	13.600	462,400.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	30,800	87.650	2,699,620.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	72,000	3.570	257,040.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	56,600	25.400	1,437,640.00	
LI NING CO LTD	58,000	57.900	3,358,200.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	20,400	66.900	1,364,760.00	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	33,000	8.490	280,170.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	31,000	16.560	513,360.00	

JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	16,000	17.460	279,360.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	37,500	20.750	778,125.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	25,600	15.360	393,216.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	374,600	78.750	29,499,750.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	100,000	6.100	610,000.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	12,000	14.280	171,360.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	27,500	66.000	1,815,000.00	
JD.COM INC - CL A	53,435	210.800	11,264,098.00	
MEITUAN-CLASS B	108,900	155.400	16,923,060.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	13,500	18.580	250,830.00	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	11,800	15.360	181,248.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	49,000	4.660	228,340.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	16,500	37.650	621,225.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	2,700	111.390	300,753.00	
CHINA FEIHE LTD	98,000	5.750	563,500.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	80,000	33.050	2,644,000.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	42,000	51.550	2,165,100.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	51,000	3.360	171,360.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	44,800	43.600	1,953,280.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	44,000	11.440	503,360.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	48,000	12.400	595,200.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	16,000	70.400	1,126,400.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	28,000	6.700	187,600.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	129,000	5.170	666,930.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	9,000	21.050	189,450.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	15,000	34.400	516,000.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	9,000	19.440	174,960.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	8,400	47.700	400,680.00	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	49,500	6.240	308,880.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	15,700	18.120	284,484.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	67,200	11.140	748,608.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	16,600	12.900	214,140.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	33,200	17.860	592,952.00	
3SBIO INC	30,500	8.110	247,355.00	
CANSINO BIOLOGICS INC-H	2,600	103.500	269,100.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	27,000	10.300	278,100.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	86,000	3.750	322,500.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	228,800	9.790	2,239,952.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	30,000	19.140	574,200.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	2,500	72.000	180,000.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	34,000	14.500	493,000.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	23,000	30.050	691,150.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	5,100	43.500	221,850.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	10,500	25.500	267,750.00	

SINO BIOPHARMACEUTICAL	271,000	4.510	1,222,210.00
WUXI APPTTEC CO LTD-H	8,711	74.150	645,920.65
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	88,500	48.950	4,332,075.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	744,000	2.570	1,912,080.00
BANK OF CHINA LTD-H	1,981,000	2.760	5,467,560.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	216,000	4.440	959,040.00
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	220,000	3.420	752,400.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	2,379,000	4.720	11,228,880.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	77,000	2.350	180,950.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	98,000	38.300	3,753,400.00
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	131,100	2.630	344,793.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	1,406,000	3.880	5,455,280.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	196,000	4.690	919,240.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	188,000	0.980	184,240.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	86,500	3.780	326,970.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	32,000	14.260	456,320.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	48,000	15.180	728,640.00
FAR EAST HORIZON LTD	28,000	6.100	170,800.00
GF SECURITIES CO LTD-H	27,200	11.060	300,832.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	60,800	4.680	284,544.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	32,400	8.950	289,980.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	189,000	11.640	2,199,960.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	65,000	17.460	1,134,900.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	35,400	7.480	264,792.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	21,700	17.640	382,788.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	174,000	2.600	452,400.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	170,000	7.830	1,331,100.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	157,500	47.250	7,441,875.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	14,900	19.000	283,100.00
A-LIVING SMART CITY SERVICES	18,250	9.240	168,630.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	66,000	1.400	92,400.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	96,000	1.860	178,560.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	94,500	21.350	2,017,575.00
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	30,000	8.850	265,500.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	80,000	35.750	2,860,000.00
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	15,800	36.000	568,800.00
CHINA VANKE CO LTD-H	39,200	16.560	649,152.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	104,000	1.250	130,000.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	170,000	3.050	518,500.00
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	54,000	19.300	1,042,200.00
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	22,500	13.060	293,850.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	34,000	5.360	182,240.00
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	13,310	9.490	126,311.90
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	47,500	23.100	1,097,250.00

SEAZEN GROUP LTD	32,000	3.800	121,600.00	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	18,500	3.650	67,525.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	53,000	3.800	201,400.00	
WHARF HOLDINGS LTD	30,000	22.350	670,500.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	29,600	9.800	290,080.00	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	66,000	6.250	412,500.00	
GDS HOLDINGS LTD-CL A	23,900	12.980	310,222.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	68,000	12.720	864,960.00	
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	12,000	6.070	72,840.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	21,000	14.260	299,460.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	13,500	17.880	241,380.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	13,000	24.550	319,150.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	13,500	24.000	324,000.00	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	21,000	7.700	161,700.00	
LENOVO GROUP LTD	178,000	6.440	1,146,320.00	
SUNNY OPTICAL TECH	18,200	90.050	1,638,910.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	377,000	9.970	3,758,690.00	
ZTE CORP-H	16,600	16.360	271,576.00	
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	9,000	19.220	172,980.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	14,000	26.600	372,400.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	120,000	8.890	1,066,800.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	1,108,000	0.820	908,560.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	10,500	23.900	250,950.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	100,000	1.940	194,000.00	
CGN POWER CO LTD-H	229,000	1.850	423,650.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	79,600	9.250	736,300.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	87,000	9.310	809,970.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	148,000	2.920	432,160.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	24,900	26.550	661,095.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	52,000	14.380	747,760.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	20,000	105.700	2,114,000.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	62,000	7.080	438,960.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	114,000	3.700	421,800.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	106,000	5.730	607,380.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	260,000	0.435	113,100.00	
BAIDU INC-CLASS A	54,350	98.150	5,334,452.50	
BILIBILI INC-CLASS Z	4,880	108.600	529,968.00	
CHINA LITERATURE LTD	12,200	27.000	329,400.00	
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	96,000	1.600	153,600.00	
KINGSOFT CORP LTD	20,200	23.600	476,720.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	43,100	54.800	2,361,880.00	
NETEASE INC	51,100	109.700	5,605,670.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	154,200	285.800	44,070,360.00	
香港・ドル小計	20,310,144		268,373,559.07	

				(4,771,681,880)	
台湾・ド ル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	24,000	84.500	2,028,000.00	
	ASIA CEMENT CORP	57,000	41.050	2,339,850.00	
	CHINA STEEL CORP	299,000	28.700	8,581,300.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	87,000	74.000	6,438,000.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	105,000	88.900	9,334,500.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	121,000	76.700	9,280,700.00	
	TAIWAN CEMENT	149,676	33.550	5,021,629.80	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	3,000	909.000	2,727,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	79,000	32.150	2,539,850.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	2,000	1,600.000	3,200,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	55,000	45.450	2,499,750.00	
	CHINA AIRLINES LTD	63,000	18.150	1,143,450.00	
	EVA AIRWAYS CORP	59,000	28.300	1,669,700.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	25,096	161.000	4,040,456.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	41,000	28.400	1,164,400.00	
	WAN HAI LINES LTD	14,605	74.700	1,090,993.50	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	43,000	65.100	2,799,300.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	44,000	34.550	1,520,200.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	4,000	450.000	1,800,000.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	10,640	190.000	2,021,600.00	
	GIANT MANUFACTURING	7,000	231.000	1,617,000.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	4,000	291.500	1,166,000.00	
	POU CHEN	54,000	32.300	1,744,200.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	7,000	639.000	4,473,000.00	
	MOMO.COM INC	1,200	602.000	722,400.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	13,000	268.500	3,490,500.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	119,000	65.800	7,830,200.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	99,741	17.250	1,720,532.25	
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	443,000	22.850	10,122,550.00	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	324,669	24.500	7,954,390.50	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	261,147	26.200	6,842,051.40	
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	218,970	22.350	4,893,979.50	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	281,700	31.500	8,873,550.00	
	SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	252,737	17.750	4,486,081.75	
	TAISHIN FINANCIAL HOLDING	265,647	15.000	3,984,705.00	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	242,108	26.500	6,415,862.00	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	88,299	47.800	4,220,692.20		
CHAILEASE HOLDING CO LTD	33,836	192.500	6,513,430.00		
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	246,284	22.500	5,541,390.00		
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	200,000	43.450	8,690,000.00		
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	381,196	13.200	5,031,787.20		
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	187,950	59.600	11,201,820.00		
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	323,432	8.850	2,862,373.20		

RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	36,270	45.900	1,664,793.00	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	12,000	268.000	3,216,000.00	
ACER INC	61,000	24.600	1,500,600.00	
ADVANTECH CO LTD	11,299	319.500	3,610,030.50	
ASUSTEK COMPUTER INC	17,000	267.000	4,539,000.00	
AUO CORP	161,600	16.150	2,609,840.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	18,000	181.000	3,258,000.00	
COMPAL ELECTRONICS	88,000	21.500	1,892,000.00	
DELTA ELECTRONICS INC	48,000	298.000	14,304,000.00	
E INK HOLDINGS INC	22,000	177.000	3,894,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	307,800	100.000	30,780,000.00	
INNOLUX CORP	242,540	12.350	2,995,369.00	
INVENTEC CORP	72,000	24.700	1,778,400.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	2,480	2,270.000	5,629,600.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	49,000	65.600	3,214,400.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	14,000	122.000	1,708,000.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	6,000	267.000	1,602,000.00	
PEGATRON CORP	53,000	61.500	3,259,500.00	
QUANTA COMPUTER INC	70,000	71.500	5,005,000.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	28,000	57.600	1,612,800.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	31,000	151.000	4,681,000.00	
WIWYNN CORP	2,000	868.000	1,736,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	33,520	47.250	1,583,820.00	
YAGEO CORPORATION	8,912	438.000	3,903,456.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	14,000	119.000	1,666,000.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	83,000	95.400	7,918,200.00	
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	500	739.000	369,500.00	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	2,000	1,455.000	2,910,000.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	5,000	465.000	2,325,000.00	
MEDIATEK INC	37,000	713.000	26,381,000.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	26,000	57.200	1,487,200.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	14,000	293.000	4,102,000.00	
PARADE TECHNOLOGIES LTD	2,000	782.000	1,564,000.00	
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	80,000	32.600	2,608,000.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	11,000	314.500	3,459,500.00	
SILERGY CORP	8,800	467.000	4,109,600.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	608,000	487.000	296,096,000.00	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	292,000	44.650	13,037,800.00	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	19,000	83.300	1,582,700.00	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	6,000	155.000	930,000.00	
WINBOND ELECTRONICS CORP	61,000	21.250	1,296,250.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	96,000	112.000	10,752,000.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	36,000	66.700	2,401,200.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	43,000	94.000	4,042,000.00	

台湾・ドル小計		8,181,654		690,654,732.80 (3,101,177,881)	
エジプト・ポンド	EASTERN CO SAE	13,558	13.900	188,456.20	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BAN	55,939	39.840	2,228,609.76	
	EFG-HERMES HOLDING SAE	15,925	14.270	227,249.75	
エジプト・ポンド小計		85,422		2,644,315.71 (14,940,119)	
トルコ・リラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	2,650	485.000	1,285,250.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	38,881	41.860	1,627,558.66	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	19,291	46.760	902,047.16	
	KOC HOLDING AS	15,538	70.800	1,100,090.40	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	39,792	38.780	1,543,133.76	
	TURK HAVA YOLLARI AO	13,066	120.500	1,574,453.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	1,688	442.800	747,446.40	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	12,175	134.400	1,636,320.00	
	AKBANK T.A.S.	70,766	17.660	1,249,727.56	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	27,103	40.580	1,099,839.74	
	TURKIYE IS BANKASI-C	86,259	10.290	887,605.11	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	27,080	34.200	926,136.00	
トルコ・リラ小計		354,289		14,579,607.79 (108,613,704)	
メキシコ・ペソ	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	77,000	72.190	5,558,630.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	3,095	257.700	797,581.50	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	20,300	37.020	751,506.00	
	ALFA S.A.B.-A	83,900	13.250	1,111,675.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	11,100	82.640	917,304.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	8,900	299.580	2,666,262.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	4,780	457.900	2,188,762.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	5,105	167.840	856,823.20	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	131,500	72.380	9,517,970.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	10,900	160.880	1,753,592.00	
	GRUMA S.A.B.-B	5,050	231.610	1,169,630.50	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	32,900	81.680	2,687,272.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	31,900	32.670	1,042,173.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	65,300	149.640	9,771,492.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	53,100	35.660	1,893,546.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	697,100	18.640	12,993,944.00	
	OPERADORA DE SITES MEX- A-1	30,400	21.560	655,424.00	
SITIOS LATINOAMERICA SAB DE	34,855	8.180	285,113.90		
メキシコ・ペソ小計		1,307,185		56,618,701.10 (408,911,583)	
フィリピン・ペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	42,090	60.000	2,525,400.00	
	AYALA CORPORATION	6,750	696.000	4,698,000.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	1,310	439.000	575,090.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	82,562	49.100	4,053,794.20	

	SM INVESTMENTS CORP	5,405	939.000	5,075,295.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	23,130	205.000	4,741,650.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	12,830	245.000	3,143,350.00	
	MONDE NISSIN CORP	155,700	12.640	1,968,048.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	17,230	133.000	2,291,590.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	49,227	105.900	5,213,139.30	
	BDO UNIBANK INC	52,070	130.100	6,774,307.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	38,980	57.300	2,233,554.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	110,900	3.460	383,714.00	
	AYALA LAND INC	198,000	31.500	6,237,000.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	284,800	36.400	10,366,720.00	
	CONVERGE INFORMATION AND COM	47,400	15.460	732,804.00	
	GLOBE TELECOM INC	620	2,300.000	1,426,000.00	
	PLDT INC	2,005	1,752.000	3,512,760.00	
	ACEN CORP	141,680	7.110	1,007,344.80	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	5,120	280.000	1,433,600.00	
	フィリピン・ペソ小計	1,277,809		68,393,160.30 (167,795,778)	
チリ・ペソ	EMPRESAS COPEC SA	10,529	6,035.000	63,542,515.00	
	EMPRESAS CMPC SA	22,543	1,473.900	33,226,127.70	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	3,601	86,250.000	310,586,250.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	374,056	70.000	26,183,920.00	
	FALABELLA SA	15,911	1,555.000	24,741,605.00	
	CENCOSUD SA	40,071	1,310.100	52,497,017.10	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	1,586	5,500.000	8,723,000.00	
	BANCO DE CHILE	1,024,325	83.650	85,684,786.25	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	1,084	24,510.000	26,568,840.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	1,825,075	34.250	62,508,818.75	
	ENEL AMERICAS SA	600,505	119.000	71,460,095.00	
	ENEL CHILE SA	364,877	40.500	14,777,518.50	
	チリ・ペソ小計	4,284,163		780,500,493.30 (119,894,242)	
コロンビア・ペソ	ECOPETROL SA	134,524	2,475.000	332,946,900.00	
	BANCOLOMBIA SA	5,994	40,700.000	243,955,800.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	12,217	30,990.000	378,604,830.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	8,110	19,080.000	154,738,800.00	
	コロンビア・ペソ小計	160,845		1,110,246,330.00 (32,032,827)	
インド・ルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	21,390	339.050	7,252,279.50	
	COAL INDIA LTD	37,979	227.200	8,628,828.80	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	15,734	238.500	3,752,559.00	
	INDIAN OIL CORP LTD	66,526	75.300	5,009,407.80	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	62,021	140.250	8,698,445.25	
	PETRONET LNG LTD	18,486	211.850	3,916,259.10	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	75,244	2,712.200	204,076,776.80	

ACC LTD	1,628	2,514.050	4,092,873.40
AMBUJA CEMENTS LTD	16,248	564.950	9,179,307.60
ASIAN PAINTS LTD	9,511	3,135.050	29,817,460.55
BERGER PAINTS INDIA LTD	6,933	612.200	4,244,382.60
GRASIM INDUSTRIES LTD	6,476	1,719.150	11,133,215.40
HINDALCO INDUSTRIES LTD	34,596	435.950	15,082,126.20
JINDAL STEEL & POWER LTD	8,561	515.000	4,408,915.00
JSW STEEL LTD	18,789	732.550	13,763,881.95
PI INDUSTRIES LTD	1,869	3,375.000	6,307,875.00
PIDILITE INDUSTRIES LTD	3,991	2,727.950	10,887,248.45
SHREE CEMENT LTD	295	23,218.350	6,849,413.25
SRF LTD	3,336	2,320.950	7,742,689.20
TATA STEEL LTD	180,637	106.100	19,165,585.70
ULTRATECH CEMENT LTD	2,491	6,928.900	17,259,889.90
UPL LTD	12,873	774.850	9,974,644.05
VEDANTA LTD	15,567	301.850	4,698,898.95
ADANI ENTERPRISES LTD	7,025	3,878.400	27,245,760.00
BHARAT ELECTRONICS LTD	90,096	106.150	9,563,690.40
HAVELLS INDIA LTD	5,714	1,234.850	7,055,932.90
LARSEN & TOUBRO LTD	17,309	2,050.550	35,492,969.95
SIEMENS LTD	1,495	2,778.700	4,154,156.50
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	6,819	723.000	4,930,137.00
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	13,018	878.200	11,432,407.60
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	6,593	759.650	5,008,372.45
INTERGLOBE AVIATION LTD	2,035	1,911.350	3,889,597.25
BAJAJ AUTO LTD	1,601	3,660.100	5,859,820.10
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	1,906	2,035.000	3,878,710.00
BHARAT FORGE LTD	5,374	848.750	4,561,182.50
EICHER MOTORS LTD	3,370	3,416.100	11,512,257.00
HERO MOTOCORP LTD	2,709	2,828.250	7,661,729.25
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	21,636	1,257.100	27,198,615.60
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,979	8,910.200	26,543,485.80
MRF LTD	47	92,565.150	4,350,562.05
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	50,106	73.300	3,672,769.80
TATA MOTORS LTD	40,931	433.150	17,729,262.65
PAGE INDUSTRIES LTD	151	47,092.350	7,110,944.85
TITAN CO LTD	8,754	2,613.750	22,880,767.50
JUBILANT FOODWORKS LTD	9,393	546.050	5,129,047.65
TRENT LTD	4,308	1,456.950	6,276,540.60
ZOMATO LTD	58,211	63.550	3,699,309.05
AVENUE SUPERMARTS LTD	3,992	3,965.100	15,828,679.20
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	2,672	4,285.350	11,450,455.20
ITC LTD	72,909	342.300	24,956,750.70
MARICO LTD	13,955	502.400	7,010,992.00

NESTLE INDIA LTD	832	20,121.200	16,740,838.40	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	13,630	805.050	10,972,831.50	
UNITED SPIRITS LTD	7,165	907.450	6,501,879.25	
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	2,569	1,602.600	4,117,079.40	
DABUR INDIA LTD	16,354	593.100	9,699,557.40	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	10,773	865.650	9,325,647.45	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	20,515	2,634.200	54,040,613.00	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	2,481	4,719.200	11,708,335.20	
AUROBINDO PHARMA LTD	6,499	466.600	3,032,433.40	
BIOCON LTD	10,292	282.100	2,903,373.20	
CIPLA LTD	11,934	1,121.150	13,379,804.10	
DIVI'S LABORATORIES LTD	3,272	3,372.700	11,035,474.40	
DR. REDDY'S LABORATORIES	2,872	4,453.350	12,790,021.20	
LUPIN LTD	4,861	751.450	3,652,798.45	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	23,658	1,049.850	24,837,351.30	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	2,503	1,635.000	4,092,405.00	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	3,304	627.350	2,072,764.40	
AXIS BANK LTD	56,886	892.550	50,773,599.30	
BANDHAN BANK LTD	13,522	234.150	3,166,176.30	
ICICI BANK LTD	127,560	946.750	120,767,430.00	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	13,704	1,925.550	26,387,737.20	
STATE BANK OF INDIA	44,000	608.550	26,776,200.00	
YES BANK LTD	277,899	17.050	4,738,177.95	
BAJAJ FINANCE LTD	6,716	6,734.150	45,226,551.40	
BAJAJ FINSERV LTD	9,410	1,632.000	15,357,120.00	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	10,122	714.750	7,234,699.50	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	42,746	2,665.250	113,928,776.50	
MUTHOOT FINANCE LTD	2,968	1,087.050	3,226,364.40	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	4,949	817.300	4,044,817.70	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	4,668	1,270.300	5,929,760.40	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	23,440	584.850	13,708,884.00	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	5,930	1,175.700	6,971,901.00	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	7,542	471.100	3,553,036.20	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	11,098	1,258.400	13,965,723.20	
DLF LTD	15,255	392.550	5,988,350.25	
GODREJ PROPERTIES LTD	3,083	1,278.550	3,941,769.65	
HCL TECHNOLOGIES LTD	26,758	1,128.950	30,208,444.10	
INFOSYS LTD	83,406	1,629.050	135,872,544.30	
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	2,246	4,912.150	11,032,688.90	
MPHASIS LTD	1,773	2,003.650	3,552,471.45	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	22,550	3,397.350	76,610,242.50	
TATA ELXSI LTD	844	6,781.750	5,723,797.00	
TECH MAHINDRA LTD	14,379	1,074.550	15,450,954.45	
WIPRO LTD	33,678	405.150	13,644,641.70	

	BHARTI AIRTEL LTD	55,035	835.850	46,001,004.75	
	INDUS TOWERS LTD	16,890	199.450	3,368,710.50	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	7,809	2,012.050	15,712,098.45	
	ADANI POWER LTD	19,015	324.700	6,174,170.50	
	ADANI TOTAL GAS LTD	6,778	3,600.000	24,400,800.00	
	ADANI TRANSMISSION LTD	7,036	2,782.700	19,579,077.20	
	GAIL INDIA LTD	48,927	94.150	4,606,477.05	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	6,611	433.500	2,865,868.50	
	NTPC LTD	95,615	170.150	16,268,892.25	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	77,378	219.350	16,972,864.30	
	TATA POWER CO LTD	35,446	223.450	7,920,408.70	
	INFO EDGE INDIA LTD	1,749	3,961.150	6,928,051.35	
	インド・ルピー小計	2,465,224		1,881,512,358.95 (3,217,386,134)	
インドネ シア・ル ピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBK P	354,800	3,880.000	1,376,624,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	38,700	30,700.000	1,188,090,000.00	
	ADARO MINERALS INDONESIA TBK	171,600	1,640.000	281,424,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	128,000	1,965.000	251,520,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	626,800	810.000	507,708,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	57,500	9,750.000	560,625,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	325,161	4,110.000	1,336,411,710.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	91,200	7,600.000	693,120,000.00	
	VALE INDONESIA TBK	52,100	7,300.000	380,330,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	516,000	6,050.000	3,121,800,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	410,100	2,840.000	1,164,684,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	175,400	5,825.000	1,021,705,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	10,800	21,450.000	231,660,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	71,100	9,975.000	709,222,500.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	87,700	6,325.000	554,702,500.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	182,700	4,700.000	858,690,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	520,000	2,100.000	1,092,000,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,382,000	8,975.000	12,403,450,000.00	
	BANK JAGO TBK PT	102,500	4,690.000	480,725,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	460,200	10,325.000	4,751,565,000.00	
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	183,900	9,375.000	1,724,062,500.00		
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	1,709,100	4,850.000	8,289,135,000.00		
SARANA MENARA NUSANTARA PT	516,500	1,145.000	591,392,500.00		
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	1,229,700	3,980.000	4,894,206,000.00		
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	118,900	2,300.000	273,470,000.00		
	インドネシア・ルピア小計	9,522,461		48,738,322,710.00 (433,771,072)	
ブラジ ル・レア ル	COSAN SA	29,988	17.270	517,892.76	
	PETRO RIO SA	17,400	35.280	613,872.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	91,700	29.380	2,694,146.00	

PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	117,400	25.380	2,979,612.00	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	17,600	13.740	241,824.00	
BRASKEM SA-PREF A	4,000	29.200	116,800.00	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	14,600	14.350	209,510.00	
GERDAU SA-PREF	29,900	31.020	927,498.00	
SUZANO SA	19,315	53.310	1,029,682.65	
VALE SA	98,688	84.440	8,333,214.72	
WEG SA	41,360	37.710	1,559,685.60	
CCR SA	32,700	11.750	384,225.00	
LOCALIZA RENT A CAR	18,930	60.420	1,143,750.60	
RUMO SA	34,000	19.460	661,640.00	
AMERICANAS SA	13,024	10.240	133,365.76	
LOJAS RENNER S.A.	24,358	22.960	559,259.68	
MAGAZINE LUIZA SA	74,900	3.360	251,664.00	
VIBRA ENERGIA SA	28,680	16.360	469,204.80	
ATACADAO SA	14,200	15.740	223,508.00	
RAIA DROGASIL SA	24,200	22.470	543,774.00	
AMBEV SA	116,500	15.760	1,836,040.00	
BRF SA	15,000	10.010	150,150.00	
JBS SA	18,400	22.460	413,264.00	
NATURA &CO HOLDING SA	22,100	11.510	254,371.00	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	114,419	5.190	593,834.61	
REDE D'OR SAO LUIZ SA	9,900	30.230	299,277.00	
HYPERA SA	10,100	44.410	448,541.00	
BANCO BRADESCO S.A.	39,481	13.340	526,676.54	
BANCO BRADESCO SA-PREF	133,536	15.510	2,071,143.36	
BANCO DO BRASIL S.A.	21,200	35.250	747,300.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	121,000	25.740	3,114,540.00	
ITAUSA SA	125,805	8.790	1,105,825.95	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	153,600	12.550	1,927,680.00	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	17,300	30.890	534,397.00	
TOTVS SA	12,900	29.210	376,809.00	
TELEFONICA BRASIL S.A.	11,300	38.440	434,372.00	
TIM SA	18,200	13.120	238,784.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	26,805	46.520	1,246,968.60	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	5,700	49.040	279,528.00	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	34,299	11.410	391,351.59	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	9,300	59.840	556,512.00	
CPFL ENERGIA SA	4,800	34.120	163,776.00	
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	4,250	39.290	166,982.50	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	22,800	27.430	625,404.00	
ブラジル・リアル小計	1,815,638		42,097,657.72 (1,105,985,454)	
チェコ・	KOMERCNI BANKA AS	1,821	690.500	1,257,400.50

コロナ	MONETA MONEY BANK AS	4,790	71.800	343,922.00	
	CEZ AS	4,177	804.500	3,360,396.50	
チェコ・コロナ小計		10,788		4,961,719.00 (29,253,799)	
韓国・ ウォン	HD HYUNDAI	1,340	64,800.000	86,832,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	1,368	175,000.000	239,400,000.00	
	S-OIL CORP	1,213	86,800.000	105,288,400.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	2,623	52,200.000	136,920,600.00	
	HYUNDAI STEEL CO	1,821	33,550.000	61,094,550.00	
	KOREA ZINC CO LTD	227	633,000.000	143,691,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	531	150,500.000	79,915,500.00	
	LG CHEM LTD	1,232	715,000.000	880,880,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	227	331,000.000	75,137,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	360	185,000.000	66,600,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	641	222,500.000	142,622,500.00	
	POSCO HOLDINGS INC	1,934	293,500.000	567,629,000.00	
	SK CHEMICALS CO LTD	144	94,800.000	13,651,200.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	526	66,200.000	34,821,200.00	
	SKC CO LTD	496	109,500.000	54,312,000.00	
	CJ CORP	498	76,900.000	38,296,200.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	1,293	41,350.000	53,465,550.00	
	DOOSAN ENERBILITY CO LTD	10,618	16,600.000	176,258,800.00	
	ECOPRO BM CO LTD	1,290	110,500.000	142,545,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	1,373	23,750.000	32,608,750.00	
	GS HOLDINGS	1,178	46,550.000	54,835,900.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	1,849	40,600.000	75,069,400.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	448	114,000.000	51,072,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,568	47,700.000	74,793,600.00	
	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	1,158	76,700.000	88,818,600.00	
	LG CORP	2,459	84,700.000	208,277,300.00	
	LG ENERGY SOLUTION	600	567,000.000	340,200,000.00	
	SAMSUNG C&T CORP	2,163	121,000.000	261,723,000.00	
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	4,316	24,550.000	105,957,800.00	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	14,496	5,160.000	74,799,360.00	
	SK INC	961	215,500.000	207,095,500.00	
	S-1 CORPORATION	219	64,200.000	14,059,800.00	
	CJ LOGISTICS	235	92,500.000	21,737,500.00	
	HMM CO LTD	7,125	21,850.000	155,681,250.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	524	172,500.000	90,390,000.00		
KOREAN AIR LINES CO LTD	4,701	25,200.000	118,465,200.00		
PAN OCEAN CO LTD	4,527	5,350.000	24,219,450.00		
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	2,114	34,050.000	71,981,700.00		
HANON SYSTEMS	4,138	8,710.000	36,041,980.00		
HYUNDAI MOBIS CO LTD	1,515	208,500.000	315,877,500.00		

HYUNDAI MOTOR CO	3,424	169,000.000	578,656,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	863	80,300.000	69,298,900.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	582	79,800.000	46,443,600.00	
KIA CORP	6,495	67,300.000	437,113,500.00	
COWAY CO LTD	1,284	55,500.000	71,262,000.00	
F&F CO LTD / NEW	502	149,500.000	75,049,000.00	
LG ELECTRONICS INC	2,622	93,800.000	245,943,600.00	
KANGWON LAND INC	2,078	24,600.000	51,118,800.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	680	72,400.000	49,232,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	172	84,100.000	14,465,200.00	
BGF RETAIL CO LTD	193	199,000.000	38,407,000.00	
E-MART INC	516	91,900.000	47,420,400.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	174	389,500.000	67,773,000.00	
KT&G CORP	2,707	96,700.000	261,766,900.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	694	116,000.000	80,504,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	808	130,000.000	105,040,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	473	33,000.000	15,609,000.00	
LG H&H	231	654,000.000	151,074,000.00	
LG H&H-PRF	35	282,500.000	9,887,500.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	2,295	64,700.000	148,486,500.00	
HLB INC	2,599	32,500.000	84,467,500.00	
SD BIOSENSOR INC	604	32,950.000	19,901,800.00	
ALTEOGEN INC	882	37,850.000	33,383,700.00	
CELLTRION INC	2,486	176,500.000	438,779,000.00	
CELLTRION PHARM INC	347	66,400.000	23,040,800.00	
GREEN CROSS CORP	79	135,500.000	10,704,500.00	
HANMI PHARM CO LTD	171	256,500.000	43,861,500.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	452	885,000.000	400,020,000.00	
SEEGENE INC	713	33,200.000	23,671,600.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	657	73,000.000	47,961,000.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	550	80,700.000	44,385,000.00	
YUHAN CORP	1,226	57,400.000	70,372,400.00	
HANA FINANCIAL GROUP	7,294	43,750.000	319,112,500.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	5,467	11,050.000	60,410,350.00	
KAKAOBANK CORP	2,498	25,050.000	62,574,900.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	9,657	51,600.000	498,301,200.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	11,380	37,350.000	425,043,000.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	13,459	12,650.000	170,256,350.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	873	57,200.000	49,935,600.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	824	36,600.000	30,158,400.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	5,528	5,640.000	31,177,920.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	8,457	6,630.000	56,069,910.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	2,376	9,490.000	22,548,240.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	1,312	35,150.000	46,116,800.00	

	DB INSURANCE CO LTD	912	61,300.000	55,905,600.00	
	MERITZ FIRE & MARINE INSURAN	969	43,700.000	42,345,300.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	759	204,500.000	155,215,500.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	2,148	70,700.000	151,863,600.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	942	124,000.000	116,808,000.00	
	ILJIN MATERIALS CO LTD	385	61,100.000	23,523,500.00	
	L&F CO LTD	576	217,000.000	124,992,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	4,881	14,500.000	70,774,500.00	
	LG INNOTEK CO LTD	382	299,000.000	114,218,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1,381	134,500.000	185,744,500.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	117,729	60,600.000	7,134,377,400.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	20,285	55,000.000	1,115,675,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	1,371	718,000.000	984,378,000.00	
	SK HYNIX INC	13,459	83,700.000	1,126,518,300.00	
	SK SQUARE CO LTD	2,713	36,650.000	99,431,450.00	
	LG UPLUS CORP	4,555	11,950.000	54,432,250.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	5,778	20,250.000	117,004,500.00	
	CHEIL WORLDWIDE INC	1,193	24,000.000	28,632,000.00	
	CJ ENM CO LTD	144	89,400.000	12,873,600.00	
	HYBE CO LTD	459	144,000.000	66,096,000.00	
	KAKAO CORP	7,811	55,900.000	436,634,900.00	
	KAKAO GAMES CORP	734	42,550.000	31,231,700.00	
	KRAFTON INC	650	219,000.000	142,350,000.00	
	NAVER CORP	3,280	182,500.000	598,600,000.00	
	NCSOFT CORP	406	454,500.000	184,527,000.00	
	NETMARBLE CORP	337	49,200.000	16,580,400.00	
	PEARL ABYSS CORP	498	43,800.000	21,812,400.00	
	韓国・ウォン小計	387,505		24,312,416,360.00 (2,547,941,235)	
マレーシ ア・リン ギット	DIALOG GROUP BHD	90,500	2.230	201,815.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	7,300	22.400	163,520.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	63,200	8.520	538,464.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	82,100	4.800	394,080.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	20,400	6.870	140,148.00	
	SIME DARBY BERHAD	47,100	2.200	103,620.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	14,700	6.270	92,169.00	
	MISC BHD	28,500	7.200	205,200.00	
	GENTING BHD	60,200	4.430	266,686.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	73,100	2.660	194,446.00	
	MR DIY GROUP M BHD	63,450	2.000	126,900.00	
	IOI CORP BHD	70,600	3.880	273,928.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	8,600	21.140	181,804.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	1,500	130.400	195,600.00	
	PPB GROUP BERHAD	13,340	16.220	216,374.80	

	QL RESOURCES BHD	29,250	5.530	161,752.50	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	59,300	4.350	257,955.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	37,700	1.760	66,352.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	41,700	5.950	248,115.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	97,900	0.875	85,662.50	
	AMMB HOLDINGS BHD	39,300	4.120	161,916.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	172,800	5.820	1,005,696.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	16,000	20.880	334,080.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	5,700	19.000	108,300.00	
	MALAYAN BANKING BHD	122,000	8.700	1,061,400.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	366,600	4.410	1,616,706.00	
	RHB BANK BHD	28,900	5.670	163,863.00	
	INARI AMERTRON BHD	52,900	2.710	143,359.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	52,900	3.090	163,461.00	
	DIGI.COM BHD	86,400	3.880	335,232.00	
	MAXIS BHD	57,900	3.910	226,389.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	34,000	5.580	189,720.00	
	PETRONAS GAS BHD	21,600	16.720	361,152.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	67,600	9.020	609,752.00	
	マレーシア・リングット小計	2,035,040		10,595,617.80 (326,235,893)	
南アフリ カ・ラン ド	EXXARO RESOURCES LTD	6,027	224.170	1,351,072.59	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	2,473	280.420	693,478.66	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	1,308	1,620.640	2,119,797.12	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	10,879	302.200	3,287,633.80	
	GOLD FIELDS LTD	22,932	184.590	4,233,017.88	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	11,645	59.760	695,905.20	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	20,959	201.450	4,222,190.55	
	KUMBA IRON ORE LTD	1,588	469.670	745,835.96	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	8,310	188.000	1,562,280.00	
	SASOL LTD	13,960	292.730	4,086,510.80	
	SIBANYE STILLWATER LTD	73,151	45.160	3,303,499.16	
	BIDVEST GROUP LTD	7,735	223.990	1,732,562.65	
	MR PRICE GROUP LTD	6,331	166.620	1,054,871.22	
	NASPERS LTD-N SHS	5,394	2,484.510	13,401,446.94	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	35,012	21.430	750,307.16	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	6,946	104.270	724,259.42	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	24,638	65.700	1,618,716.60	
	BID CORP LTD	8,268	328.260	2,714,053.68	
	CLICKS GROUP LTD	6,014	289.270	1,739,669.78	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	12,962	250.160	3,242,573.92	
SPAR GROUP LIMITED/THE	4,180	137.000	572,660.00		
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	9,393	142.750	1,340,850.75		
ABSA GROUP LTD	19,853	202.180	4,013,879.54		

	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	2,146	1,982.500	4,254,445.00	
	NEDBANK GROUP LTD	11,348	225.010	2,553,413.48	
	STANDARD BANK GROUP LTD	33,094	177.970	5,889,739.18	
	FIRSTRAND LTD	124,451	65.040	8,094,293.04	
	REINET INVESTMENTS SCA	2,879	304.350	876,223.65	
	REMGRO LTD	13,046	142.200	1,855,141.20	
	DISCOVERY LTD	12,309	123.920	1,525,331.28	
	OLD MUTUAL LTD	116,070	10.940	1,269,805.80	
	SANLAM LTD	43,917	54.910	2,411,482.47	
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	11,259	101.410	1,141,775.19	
	MTN GROUP LTD	42,837	135.950	5,823,690.15	
	VODACOM GROUP LTD	16,889	127.100	2,146,591.90	
	MULTICHOICE GROUP LTD	7,894	119.000	939,386.00	
	南アフリカ・ランド小計	758,097		97,988,391.72 (799,585,275)	
タイ・ パーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	34,300	188.500	6,465,550.00	
	PTT PCL-NVDR	252,400	33.250	8,392,300.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	24,800	55.500	1,376,400.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	35,700	41.750	1,490,475.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	61,700	48.250	2,977,025.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	27,300	55.750	1,521,975.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	19,200	340.000	6,528,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	105,600	74.500	7,867,200.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR	221,600	9.300	2,060,880.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	229,500	8.250	1,893,375.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	184,500	6.200	1,143,900.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	72,700	30.250	2,199,175.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	36,791	42.500	1,563,617.50	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	166,900	14.500	2,420,050.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	72,100	24.400	1,759,240.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	19,000	33.500	636,500.00	
	CP ALL PCL-NVDR	148,700	63.500	9,442,450.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	5,400	94.500	510,300.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	106,800	23.700	2,531,160.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	38,500	28.000	1,078,000.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	58,800	17.200	1,011,360.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	254,600	29.750	7,574,350.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	14,700	219.000	3,219,300.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	16,500	145.500	2,400,750.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	103,500	17.600	1,821,600.00	
	SCB X PCL-NVDR	23,400	105.000	2,457,000.00	
BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	43,300	15.500	671,150.00		
JMT NETWORK SERVICES-NVDR	16,600	66.000	1,095,600.00		
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	27,100	58.750	1,592,125.00		

	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	16,200	37.000	599,400.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	11,800	45.250	533,950.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	46,300	69.500	3,217,850.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	176,900	9.450	1,671,705.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	7,700	656.000	5,051,200.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	29,300	190.000	5,567,000.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	27,000	73.750	1,991,250.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	259,200	4.540	1,176,768.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	20,900	37.000	773,300.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	5,500	172.000	946,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	44,900	94.750	4,254,275.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	14,800	69.500	1,028,600.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	78,100	52.000	4,061,200.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	19,600	41.000	803,600.00	
	タイ・パーツ小計	3,180,191		117,376,905.50 (461,291,239)	
ポーランド・ズロチ	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	13,722	64.800	889,185.60	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	3,845	115.400	443,713.00	
	LPP SA	23	9,435.000	217,005.00	
	ALLEGRO.EU SA	10,674	23.100	246,569.40	
	DINO POLSKA SA	1,310	370.000	484,700.00	
	BANK PEKAO SA	3,856	83.880	323,441.28	
	MBANK SA	302	316.000	95,432.00	
	PKO BANK POLSKI SA	23,204	28.350	657,833.40	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	751	268.400	201,568.40	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	16,272	31.800	517,449.60	
	ORANGE POLSKA SA	15,737	6.922	108,931.51	
	PGE SA	19,508	6.380	124,461.04	
	CD PROJEKT SA	1,469	131.480	193,144.12	
	CYFROWY POLSAT SA	5,742	18.680	107,260.56	
	ポーランド・ズロチ小計	116,415		4,610,694.91 (141,603,201)	
ハンガリー・フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	8,186	2,790.000	22,838,940.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	2,331	8,420.000	19,627,020.00	
	OTP BANK PLC	4,109	10,700.000	43,966,300.00	
	ハンガリー・フォリント小計	14,626		86,432,260.00 (30,561,583)	
ユーロ	MYTILINEOS S.A.	2,326	17.890	41,612.14	
	FF GROUP	123	4.800	590.40	
	OPAP SA	4,784	13.160	62,957.44	
	JUMBO SA	2,851	14.970	42,679.47	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	53,592	1.030	55,199.76	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	64,000	1.077	68,928.00	
	NATIONAL BANK OF GREECE	13,389	3.760	50,342.64	

	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	5,406	14.780	79,900.68	
	PUBLIC POWER CORP	4,579	6.680	30,587.72	
	ユーロ小計	151,050		432,798.25 (62,141,173)	
	合計	56,715,266		18,551,125,070 (18,551,125,070)	

(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 31銘柄	2.5%	3.6%
香港・ドル	株式 195銘柄	18.0%	25.7%
台湾・ドル	株式 87銘柄	11.7%	16.7%
エジプト・ポンド	株式 3銘柄	0.1%	0.1%
トルコ・リラ	株式 12銘柄	0.4%	0.6%
メキシコ・ペソ	株式 18銘柄	1.5%	2.2%
フィリピン・ペソ	株式 20銘柄	0.6%	0.9%
チリ・ペソ	株式 12銘柄	0.5%	0.6%
コロンビア・ペソ	株式 4銘柄	0.1%	0.2%
インド・ルピー	株式 107銘柄	12.1%	17.3%
インドネシア・ルピア	株式 25銘柄	1.6%	2.3%
ブラジル・レアル	株式 44銘柄	4.2%	6.0%
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	9.6%	13.7%
マレーシア・リングgit	株式 34銘柄	1.2%	1.8%
南アフリカ・ランド	株式 36銘柄	3.0%	4.3%
タイ・バーツ	株式 43銘柄	1.7%	2.5%
ポーランド・ズロチ	株式 14銘柄	0.5%	0.8%
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.1%	0.2%
ユーロ	株式 9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	1,403,800.00	55,674,708.00	
		オフショア・人民元小計	1,403,800.00	55,674,708.00 (1,080,935,590)	
投資信託受益証券合計				1,080,935,590 (1,080,935,590)	
投資証券	アメリカ・ドル	ISHARES MSCI KUWAIT ETF	37,235.00	1,311,975.22	
		ISHARES MSCI QATAR ETF	82,108.00	1,672,539.96	
		ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	166,080.00	6,505,353.60	
		ISHARES MSCI UAE ETF	130,807.00	2,001,347.10	
	アメリカ・ドル小計			416,230.00	11,491,215.88 (1,595,785,149)

メキシコ・ペソ	CEMEX SAB-CPO	393,600.00	3,329,856.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	12,945.00	1,673,529.60	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	47,900.00	7,239,606.00	
	GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	54,100.00	1,118,247.00	
	TRUST FIBRA UNO	66,400.00	1,594,264.00	
メキシコ・ペソ小計		574,945.00	14,955,502.60 (108,011,631)	
ブラジル・リアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	29,100.00	729,246.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	7,800.00	214,968.00	
	ENERGISA SA-UNITS	4,800.00	207,072.00	
	KLABIN SA - UNIT	17,500.00	350,000.00	
ブラジル・リアル小計		59,200.00	1,501,286.00 (39,441,636)	
南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	72,006.00	1,018,164.84	
	南アフリカ・ランド小計	72,006.00	1,018,164.84 (8,308,225)	
投資証券合計			1,751,546,641 (1,751,546,641)	
合 計			2,832,482,231 (2,832,482,231)	

(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	-	6.0%	56.3%
メキシコ・ペソ	投資証券	5銘柄	-	0.4%	3.8%
ブラジル・リアル	投資証券	4銘柄	-	0.1%	1.4%
オフショア・人民元	投資信託受益証券	1銘柄	4.1%	-	38.2%
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。

外国債券パッシブ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2021年11月30日現在)	(2022年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	396,577,581	444,208,536
金銭信託	32,775,079	152,609,385

コール・ローン	966,644,903	941,613,352
国債証券	158,467,947,570	151,679,008,052
未収入金	160,000,000	-
未収利息	923,046,863	973,583,208
前払費用	27,752,110	46,285,888
流動資産合計	160,974,744,106	154,237,308,421
資産合計	160,974,744,106	154,237,308,421
負債の部		
流動負債		
未払解約金	64,889,630	27,774,541
その他未払費用	4,621	3,600
流動負債合計	64,894,251	27,778,141
負債合計	64,894,251	27,778,141
純資産の部		
元本等		
元本	81,104,632,252	77,181,314,549
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	79,805,217,603	77,028,215,731
元本等合計	160,909,849,855	154,209,530,280
純資産合計	160,909,849,855	154,209,530,280
負債純資産合計	160,974,744,106	154,237,308,421

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<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。
----------------------------	---

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年11月30日現在)	(2022年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	81,104,632,252口	77,181,314,549口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.9840円 (1万口当たりの純資産額19,840円)	1口当たり純資産額 1.9980円 (1万口当たりの純資産額19,980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12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、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と、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11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 2021年12月1日
至 2022年11月30日

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

(その他の注記)

(2021年11月30日現在)

開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	81,286,495,969円
同期中における追加設定元本額	2,319,084,008円
同期中における一部解約元本額	2,500,947,725円
2021年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	24,425,521,726円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	758,942,184円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,105,125,950円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,117,964,664円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	157,128,366円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	6,821,569円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	30,281,532円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	100,943,914円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	215,135,121円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	146,946,116円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	249,088,888円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	25,674,124円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	85,391,716円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	109,913,482円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	77,222,607円
イオン・バランス戦略ファンド	49,411,643円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	16,988,179円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	66,333,551円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	48,301,118円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	117,660,697円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	33,967,007円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	16,515,743円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	115,080,948円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	216,500,817円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	12,164,325円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	34,944,842円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	23,626,754円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,299,105円
日興F W S・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	127,761,903円
三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド	3,423,237円
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>	2,393,064,796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>	44,105,389円
S M A M・バランスファンドV A 2 5<適格機関投資家専用>	7,457,552,993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>	4,630,256,069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>	10,737,712,617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>	35,392,217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>	93,650,011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 >	726,204,731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 >	117,631,749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 >	1,068,564,548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 >	1,446,325,136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 >	1,571,810,158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 >	4,949,497,571円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	632,409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 >	8,245,225,547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)	334,892,322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 >	150,359,802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 >	81,241,152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 >	34,472,321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 >	97,489,920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 >	426,754,581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 >	106,160,593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 >	40,181,590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 >	1,054,447,345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 >	661,340,146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 >	960,695,213円
S M A M ・ 世界バランスファンド V A < 適格機関投資家限定 >	1,204,599,718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 >	418,833,625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 >	12,768,298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 >	141,011,485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 >	245,134,628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 >	265,817,919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 >	836,545,356円
合 計	81,104,632,252円

(2022年11月30日現在)

開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	81,104,632,252円
同期中における追加設定元本額	11,875,698,156円
同期中における一部解約元本額	15,799,015,859円

2022年11月30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	25,756,264,406円
三井住友・ D C 年金バランス 3 0 (債券重点型)	840,993,972円
三井住友・ D C 年金バランス 5 0 (標準型)	2,169,853,266円
三井住友・ D C 年金バランス 7 0 (株式重点型)	1,201,023,285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)	153,754,294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)	6,205,170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)	28,041,920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)	96,060,756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)	254,625,421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)	182,408,320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)	295,713,172円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	22,875,033円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	180,504,559円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	196,065,249円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	127,100,213円
イオン・バランス戦略ファンド	150,083,028円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	24,330,578円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	81,016,637円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	61,389,948円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	162,182,842円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	49,154,614円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	24,004,429円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	167,708,487円
三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド	632,445,610円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	32,709,599円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	98,399,536円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	65,027,461円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	3,130,696円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	766,936,458円
三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド	40,133,426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>	3,677,884,570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>	30,152,077円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	5,820,669,217円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	3,997,274,168円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	9,331,565,400円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	30,338,011円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	75,478,804円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	631,815,767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>	109,386,082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>	1,336,489,741円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	4,160,020,552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>	7,097,718,053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)	315,261,191円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	122,294,061円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	67,641,422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>	365,865,953円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	87,335,608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>	5,460,174円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	898,659,693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>	557,262,211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>	740,186,895円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	424,473,864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>	110,869,714円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	14,708,323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>	19,121,369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>	623,061,467円
合計	77,181,314,549円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	T 0.125 02/15/24	7,700,000.00	7,284,277.00	
		T 0.25 05/31/25	4,400,000.00	3,977,160.00	
		T 0.25 06/30/25	2,900,000.00	2,619,512.00	
		T 0.25 07/31/25	300,000.00	269,928.00	
		T 0.25 09/30/25	2,000,000.00	1,791,780.00	
		T 0.25 10/31/25	1,000,000.00	892,300.00	
		T 0.25 11/15/23	3,000,000.00	2,874,480.00	
		T 0.375 04/30/25	3,000,000.00	2,728,110.00	
		T 0.375 07/31/27	2,500,000.00	2,120,200.00	
		T 0.375 09/15/24	3,000,000.00	2,786,130.00	
		T 0.375 09/30/27	4,800,000.00	4,047,744.00	
		T 0.375 11/30/25	2,000,000.00	1,785,140.00	
		T 0.375 12/31/25	3,000,000.00	2,673,150.00	
		T 0.5 03/31/25	600,000.00	549,510.00	
		T 0.5 04/30/27	1,200,000.00	1,031,616.00	
		T 0.5 05/31/27	2,500,000.00	2,141,775.00	
		T 0.5 06/30/27	4,000,000.00	3,418,120.00	
		T 0.5 10/31/27	1,000,000.00	846,990.00	
		T 0.625 03/31/27	2,400,000.00	2,077,392.00	
		T 0.625 05/15/30	7,500,000.00	5,984,400.00	
		T 0.625 07/31/26	3,600,000.00	3,171,924.00	
		T 0.625 08/15/30	7,000,000.00	5,552,960.00	
		T 0.625 10/15/24	4,400,000.00	4,094,904.00	
		T 0.625 11/30/27	2,100,000.00	1,785,147.00	
		T 0.625 12/31/27	7,200,000.00	6,105,600.00	
		T 0.75 01/31/28	5,900,000.00	5,023,496.00	
T 0.75 11/15/24	5,200,000.00	4,835,792.00			
T 0.875 01/31/24	2,000,000.00	1,912,340.00			

T 0.875 11/15/30	7,000,000.00	5,652,990.00	
T 1 07/31/28	5,900,000.00	5,027,626.00	
T 1 12/15/24	4,500,000.00	4,198,005.00	
T 1.125 01/15/25	2,000,000.00	1,866,000.00	
T 1.125 02/15/31	8,500,000.00	6,992,865.00	
T 1.125 02/28/25	1,500,000.00	1,395,930.00	
T 1.125 02/28/27	2,000,000.00	1,774,600.00	
T 1.125 05/15/40	2,000,000.00	1,272,180.00	
T 1.125 08/15/40	3,200,000.00	2,019,232.00	
T 1.125 08/31/28	3,500,000.00	2,999,325.00	
T 1.25 05/15/50	5,100,000.00	2,832,846.00	
T 1.25 06/30/28	3,000,000.00	2,599,200.00	
T 1.25 08/15/31	5,200,000.00	4,248,920.00	
T 1.25 09/30/28	4,500,000.00	3,875,265.00	
T 1.25 11/30/26	4,200,000.00	3,764,376.00	
T 1.25 12/31/26	2,300,000.00	2,057,672.00	
T 1.375 01/31/25	1,900,000.00	1,781,535.00	
T 1.375 08/15/50	4,500,000.00	2,583,270.00	
T 1.375 08/31/26	7,100,000.00	6,426,565.00	
T 1.375 10/31/28	6,000,000.00	5,194,680.00	
T 1.375 11/15/31	4,900,000.00	4,023,733.00	
T 1.375 11/15/40	2,000,000.00	1,318,900.00	
T 1.375 12/31/28	2,500,000.00	2,163,175.00	
T 1.5 01/31/27	4,400,000.00	3,971,000.00	
T 1.5 02/15/25	3,000,000.00	2,815,410.00	
T 1.5 02/15/30	2,100,000.00	1,801,569.00	
T 1.5 09/30/24	3,000,000.00	2,839,800.00	
T 1.5 10/31/24	5,500,000.00	5,198,325.00	
T 1.5 11/30/24	800,000.00	754,744.00	
T 1.5 11/30/28	2,300,000.00	2,004,220.00	
T 1.625 02/15/26	2,900,000.00	2,674,786.00	
T 1.625 05/15/26	14,950,000.00	13,734,714.50	
T 1.625 05/15/31	5,500,000.00	4,667,245.00	
T 1.625 08/15/29	450,000.00	392,076.00	
T 1.625 09/30/26	3,900,000.00	3,564,834.00	
T 1.625 10/31/23	3,000,000.00	2,917,260.00	
T 1.625 11/15/50	3,200,000.00	1,965,248.00	
T 1.625 11/30/26	200,000.00	182,022.00	
T 1.75 01/31/29	4,300,000.00	3,791,353.00	
T 1.75 03/15/25	1,500,000.00	1,414,560.00	
T 1.75 06/30/24	6,200,000.00	5,927,510.00	
T 1.75 07/31/24	850,000.00	810,687.50	
T 1.75 08/15/41	2,900,000.00	2,010,048.00	
T 1.75 11/15/29	1,300,000.00	1,143,337.00	

T 1.75 12/31/24	4,000,000.00	3,787,960.00	
T 1.75 12/31/26	3,500,000.00	3,198,650.00	
T 1.875 02/15/32	5,300,000.00	4,531,500.00	
T 1.875 02/15/41	2,800,000.00	2,008,776.00	
T 1.875 02/15/51	5,800,000.00	3,803,524.00	
T 1.875 02/28/27	3,400,000.00	3,114,434.00	
T 1.875 02/28/29	2,800,000.00	2,487,492.00	
T 1.875 08/31/24	3,800,000.00	3,624,516.00	
T 1.875 11/15/51	1,300,000.00	850,577.00	
T 2 02/15/25	3,500,000.00	3,321,710.00	
T 2 02/15/50	2,800,000.00	1,904,196.00	
T 2 04/30/24	2,000,000.00	1,925,220.00	
T 2 05/31/24	3,300,000.00	3,170,805.00	
T 2 06/30/24	4,100,000.00	3,935,016.00	
T 2 08/15/25	3,300,000.00	3,108,171.00	
T 2 08/15/51	2,900,000.00	1,960,893.00	
T 2 11/15/26	5,000,000.00	4,619,300.00	
T 2 11/15/41	3,800,000.00	2,750,516.00	
T 2.125 02/29/24	2,000,000.00	1,936,480.00	
T 2.125 03/31/24	6,500,000.00	6,283,160.00	
T 2.125 05/15/25	600,000.00	568,968.00	
T 2.125 07/31/24	3,500,000.00	3,358,740.00	
T 2.125 09/30/24	4,000,000.00	3,830,920.00	
T 2.125 11/30/23	3,100,000.00	3,022,252.00	
T 2.125 11/30/24	2,600,000.00	2,483,806.00	
T 2.25 01/31/24	2,200,000.00	2,137,938.00	
T 2.25 02/15/27	4,400,000.00	4,094,728.00	
T 2.25 02/15/52	1,700,000.00	1,221,994.00	
T 2.25 03/31/26	13,300,000.00	12,517,029.00	
T 2.25 04/30/24	3,800,000.00	3,672,320.00	
T 2.25 05/15/41	3,000,000.00	2,291,460.00	
T 2.25 08/15/27	4,200,000.00	3,890,250.00	
T 2.25 08/15/46	2,450,000.00	1,770,884.50	
T 2.25 08/15/49	3,500,000.00	2,534,490.00	
T 2.25 10/31/24	800,000.00	767,000.00	
T 2.25 11/15/24	5,100,000.00	4,885,800.00	
T 2.25 11/15/25	4,000,000.00	3,780,000.00	
T 2.25 11/15/27	4,400,000.00	4,060,012.00	
T 2.25 12/31/23	3,000,000.00	2,921,010.00	
T 2.25 12/31/24	3,900,000.00	3,729,960.00	
T 2.375 02/15/42	2,800,000.00	2,163,644.00	
T 2.375 02/29/24	3,700,000.00	3,594,476.00	
T 2.375 03/31/29	2,800,000.00	2,560,236.00	
T 2.375 05/15/27	3,000,000.00	2,799,120.00	

T 2.375 05/15/29	2,400,000.00	2,192,712.00	
T 2.375 05/15/51	1,400,000.00	1,035,888.00	
T 2.375 08/15/24	5,600,000.00	5,392,184.00	
T 2.375 11/15/49	1,900,000.00	1,415,044.00	
T 2.5 01/31/25	3,400,000.00	3,263,456.00	
T 2.5 02/15/45	3,600,000.00	2,759,040.00	
T 2.5 02/15/46	2,900,000.00	2,208,292.00	
T 2.5 02/28/26	2,100,000.00	1,992,438.00	
T 2.5 03/31/27	3,000,000.00	2,818,350.00	
T 2.5 05/15/24	5,700,000.00	5,522,274.00	
T 2.5 05/15/46	3,600,000.00	2,738,808.00	
T 2.625 01/31/26	2,700,000.00	2,574,801.00	
T 2.625 02/15/29	1,800,000.00	1,672,380.00	
T 2.625 03/31/25	1,000,000.00	962,690.00	
T 2.625 04/15/25	2,500,000.00	2,400,975.00	
T 2.625 05/31/27	3,000,000.00	2,832,060.00	
T 2.625 07/31/29	1,100,000.00	1,019,557.00	
T 2.625 12/31/23	1,900,000.00	1,857,250.00	
T 2.625 12/31/25	1,400,000.00	1,337,154.00	
T 2.75 02/15/24	5,100,000.00	4,980,252.00	
T 2.75 02/15/28	4,800,000.00	4,526,208.00	
T 2.75 02/28/25	2,000,000.00	1,930,000.00	
T 2.75 04/30/27	2,700,000.00	2,562,138.00	
T 2.75 05/15/25	3,000,000.00	2,888,670.00	
T 2.75 05/31/29	1,400,000.00	1,308,230.00	
T 2.75 06/30/25	900,000.00	866,772.00	
T 2.75 08/15/32	4,200,000.00	3,860,850.00	
T 2.75 08/15/42	2,000,000.00	1,638,280.00	
T 2.75 08/15/47	3,300,000.00	2,636,766.00	
T 2.75 08/31/25	3,400,000.00	3,266,652.00	
T 2.75 11/15/23	4,200,000.00	4,121,880.00	
T 2.75 11/15/42	300,000.00	245,049.00	
T 2.75 11/15/47	1,500,000.00	1,198,875.00	
T 2.875 04/30/25	400,000.00	386,280.00	
T 2.875 04/30/29	3,500,000.00	3,295,845.00	
T 2.875 05/15/28	9,000,000.00	8,522,190.00	
T 2.875 05/15/32	5,700,000.00	5,303,850.00	
T 2.875 05/15/43	2,400,000.00	1,996,872.00	
T 2.875 05/15/49	1,400,000.00	1,155,980.00	
T 2.875 05/15/52	1,700,000.00	1,407,005.00	
T 2.875 05/31/25	3,100,000.00	2,992,709.00	
T 2.875 06/15/25	2,000,000.00	1,931,480.00	
T 2.875 08/15/28	4,500,000.00	4,252,500.00	
T 2.875 08/15/45	3,300,000.00	2,702,106.00	

T 2.875 10/31/23	1,000,000.00	983,550.00	
T 2.875 11/15/46	800,000.00	654,432.00	
T 2.875 11/30/23	2,000,000.00	1,964,140.00	
T 2.875 11/30/25	2,500,000.00	2,407,025.00	
T 3 02/15/47	2,500,000.00	2,090,425.00	
T 3 02/15/48	2,400,000.00	2,012,808.00	
T 3 02/15/49	3,300,000.00	2,790,018.00	
T 3 05/15/42	800,000.00	686,368.00	
T 3 05/15/45	3,000,000.00	2,513,190.00	
T 3 05/15/47	1,800,000.00	1,506,852.00	
T 3 07/15/25	2,000,000.00	1,935,380.00	
T 3 08/15/48	900,000.00	757,188.00	
T 3 09/30/25	1,000,000.00	966,950.00	
T 3 10/31/25	2,600,000.00	2,512,146.00	
T 3 11/15/44	3,500,000.00	2,940,245.00	
T 3 11/15/45	2,700,000.00	2,260,170.00	
T 3.125 02/15/42	1,000,000.00	879,060.00	
T 3.125 02/15/43	2,300,000.00	1,996,492.00	
T 3.125 05/15/48	2,400,000.00	2,064,168.00	
T 3.125 08/15/25	3,000,000.00	2,911,500.00	
T 3.125 08/15/44	2,300,000.00	1,976,735.00	
T 3.125 11/15/28	2,900,000.00	2,774,024.00	
T 3.25 05/15/42	1,000,000.00	892,420.00	
T 3.25 06/30/29	3,000,000.00	2,887,830.00	
T 3.375 05/15/44	500,000.00	448,590.00	
T 3.375 08/15/42	3,000,000.00	2,728,110.00	
T 3.375 11/15/48	3,100,000.00	2,801,625.00	
T 3.5 02/15/39	200,000.00	191,186.00	
T 3.625 02/15/44	600,000.00	561,234.00	
T 3.625 08/15/43	2,400,000.00	2,252,040.00	
T 3.75 08/15/41	1,500,000.00	1,450,425.00	
T 3.75 11/15/43	700,000.00	668,444.00	
T 3.875 08/15/40	500,000.00	495,310.00	
T 3.875 09/30/29	3,500,000.00	3,501,610.00	
T 4.25 05/15/39	100,000.00	104,710.00	
T 4.25 10/15/25	2,000,000.00	1,999,440.00	
T 4.25 11/15/40	600,000.00	623,526.00	
T 4.375 05/15/40	900,000.00	952,380.00	
T 4.375 05/15/41	300,000.00	316,545.00	
T 4.375 11/15/39	300,000.00	318,138.00	
T 4.5 08/15/39	300,000.00	323,577.00	
T 4.625 02/15/40	200,000.00	218,578.00	
T 4.75 02/15/41	900,000.00	995,832.00	
T 5.25 11/15/28	500,000.00	532,850.00	

	T 5.375 02/15/31	320,000.00	355,049.60	
	T 6 02/15/26	1,000,000.00	1,052,650.00	
	T-BOND 15/11/2027	1,000,000.00	1,093,510.00	
	アメリカ・ドル小計	621,420,000.00	551,332,717.10 (76,563,574,424)	
カナダ・ドル	CAN 0.5 09/01/25	2,700,000.00	2,474,874.00	
	CAN 1 06/01/27	1,100,000.00	1,000,659.00	
	CAN 1.25 06/01/30	5,700,000.00	5,039,769.00	
	CAN 1.5 04/01/25	700,000.00	663,726.00	
	CAN 1.5 06/01/26	3,200,000.00	2,998,240.00	
	CAN 1.5 09/01/24	2,200,000.00	2,110,064.00	
	CAN 1.5 12/01/31	2,300,000.00	2,029,382.00	
	CAN 1.75 12/01/53	600,000.00	446,658.00	
	CAN 2 06/01/28	700,000.00	663,565.00	
	CAN 2.25 03/01/24	1,000,000.00	977,560.00	
	CAN 2.25 06/01/25	500,000.00	482,700.00	
	CAN 2.25 06/01/29	1,600,000.00	1,531,296.00	
	CAN 2.25 12/01/29	1,600,000.00	1,528,208.00	
	CAN 2.5 06/01/24	2,100,000.00	2,054,220.00	
	CAN 2.75 12/01/48	1,300,000.00	1,230,502.00	
	CAN 3.5 12/01/45	1,200,000.00	1,281,372.00	
	CAN 4 06/01/41	1,900,000.00	2,135,505.00	
	CAN 5 06/01/37	600,000.00	732,222.00	
	CAN 5.75 06/01/29	250,000.00	290,070.00	
	CAN 5.75 06/01/33	400,000.00	496,496.00	
CANADA 2.75 12/01/64	700,000.00	652,316.00		
	カナダ・ドル小計	32,350,000.00	30,819,404.00 (3,148,510,313)	
オーストラリア・ドル	ACGB 0.25 11/21/25	800,000.00	732,792.00	
	ACGB 1.5 06/21/31	4,700,000.00	3,989,078.00	
	ACGB 1.75 06/21/51	500,000.00	311,070.00	
	ACGB 2.25 05/21/28	1,800,000.00	1,698,606.00	
	ACGB 2.5 05/21/30	2,600,000.00	2,428,712.00	
	ACGB 2.75 04/21/24	2,500,000.00	2,486,200.00	
	ACGB 2.75 06/21/35	800,000.00	720,000.00	
	ACGB 2.75 11/21/27	900,000.00	875,655.00	
	ACGB 2.75 11/21/28	200,000.00	192,832.00	
	ACGB 2.75 11/21/29	1,800,000.00	1,719,108.00	
	ACGB 3 03/21/47	1,200,000.00	1,010,616.00	
	ACGB 3 11/21/33	1,000,000.00	942,640.00	
	ACGB 3.25 04/21/25	1,300,000.00	1,302,210.00	
	ACGB 3.25 04/21/29	800,000.00	791,208.00	
	ACGB 3.25 06/21/39	2,000,000.00	1,832,300.00	
ACGB 3.75 04/21/37	1,200,000.00	1,185,780.00		

	ACGB 4.25 04/21/26	2,150,000.00	2,217,768.00	
	ACGB 4.5 04/21/33	900,000.00	969,264.00	
	オーストラリア・ドル小計	27,150,000.00	25,405,839.00 (2,357,407,801)	
シンガ ポール・ ドル	SIGB 1.25 11/01/26	500,000.00	468,650.00	
	SIGB 1.625 07/01/31	1,000,000.00	892,750.00	
	SIGB 2.25 08/01/36	800,000.00	732,888.00	
	SIGB 2.625 05/01/28	800,000.00	786,480.00	
	SIGB 2.75 03/01/46	800,000.00	789,600.00	
	SIGB 2.75 04/01/42	600,000.00	589,584.00	
	SIGB 2.875 09/01/30	200,000.00	197,100.00	
	SIGB 3 09/01/24	1,000,000.00	998,740.00	
	SIGB 3.375 09/01/33	300,000.00	309,450.00	
	SIGB 3.5 03/01/27	1,100,000.00	1,123,100.00	
	シンガポール・ドル小計	7,100,000.00	6,888,342.00 (695,998,076)	
ニュー ジーラン ド・ドル	NZGB 1.75 05/15/41	500,000.00	337,135.00	
	NZGB 2 05/15/32	300,000.00	251,061.00	
	NZGB 2.75 04/15/25	1,100,000.00	1,053,899.00	
	NZGB 2.75 05/15/51	500,000.00	374,995.00	
	NZGB 3 04/20/29	600,000.00	560,268.00	
	NZGB 4.5 04/15/27	1,100,000.00	1,106,303.00	
	ニュージーランド・ドル小計	4,100,000.00	3,683,661.00 (317,273,722)	
イギリ ス・ボン ド	UK TSY GILT	400,000.00	285,812.00	
	UKT 0.125 01/30/26	1,300,000.00	1,185,379.00	
	UKT 0.125 01/31/28	500,000.00	427,500.00	
	UKT 0.25 01/31/25	700,000.00	654,220.00	
	UKT 0.25 07/31/31	1,300,000.00	1,017,068.00	
	UKT 0.375 10/22/26	900,000.00	807,741.00	
	UKT 0.375 10/22/30	1,800,000.00	1,456,146.00	
	UKT 0.5 01/31/29	1,600,000.00	1,358,048.00	
	UKT 0.5 10/22/61	100,000.00	43,410.00	
	UKT 0.625 06/07/25	2,900,000.00	2,724,753.00	
	UKT 0.625 07/31/35	1,300,000.00	937,898.00	
	UKT 0.875 10/22/29	500,000.00	430,665.00	
	UKT 1 01/31/32	1,000,000.00	827,620.00	
	UKT 1 04/22/24	800,000.00	775,920.00	
	UKT 1.125 10/22/73	300,000.00	161,589.00	
	UKT 1.25 07/22/27	200,000.00	183,274.00	
	UKT 1.25 07/31/51	500,000.00	307,955.00	
	UKT 1.5 07/22/26	1,100,000.00	1,037,971.00	
	UKT 1.5 07/22/47	2,000,000.00	1,363,940.00	
	UKT 1.625 10/22/28	300,000.00	275,742.00	

	UKT 1.625 10/22/54	500,000.00	338,230.00	
	UKT 1.75 01/22/49	1,250,000.00	898,562.50	
	UKT 1.75 09/07/37	100,000.00	80,715.00	
	UKT 2 09/07/25	1,100,000.00	1,067,055.00	
	UKT 2.5 07/22/65	1,600,000.00	1,392,976.00	
	UKT 2.75 09/07/24	900,000.00	891,171.00	
	UKT 3.25 01/22/44	1,600,000.00	1,542,896.00	
	UKT 3.5 01/22/45	1,250,000.00	1,255,237.50	
	UKT 3.5 07/22/68	1,300,000.00	1,439,295.00	
	UKT 3.75 07/22/52	1,200,000.00	1,288,368.00	
	UKT 4 01/22/60	1,300,000.00	1,533,168.00	
	UKT 4.25 03/07/36	900,000.00	985,653.00	
	UKT 4.25 06/07/32	500,000.00	547,845.00	
	UKT 4.25 09/07/39	600,000.00	658,506.00	
	UKT 4.25 12/07/27	900,000.00	940,275.00	
	UKT 4.25 12/07/40	600,000.00	662,118.00	
	UKT 4.25 12/07/46	1,500,000.00	1,693,215.00	
	UKT 4.25 12/07/49	900,000.00	1,029,672.00	
	UKT 4.25 12/07/55	1,700,000.00	2,025,890.00	
	UKT 4.5 09/07/34	1,100,000.00	1,234,706.00	
	UKT 4.5 12/07/42	1,050,000.00	1,209,337.50	
	UKT 4.75 12/07/30	1,150,000.00	1,286,482.00	
	UKT 4.75 12/07/38	1,000,000.00	1,160,330.00	
	UKT 5 03/07/25	1,300,000.00	1,349,842.00	
	UKT 6 12/07/28	650,000.00	745,556.50	
	イギリス・ボンド小計	45,450,000.00	43,519,753.00 (7,234,288,541)	
イスラエル・シュケル	ILGOV 0.5 04/30/25	4,500,000.00	4,203,225.00	
	ILGOV 1 03/31/30	700,000.00	595,455.00	
	ILGOV 1.5 11/30/23	2,200,000.00	2,164,184.00	
	ILGOV 2.25 09/28/28	500,000.00	471,275.00	
	ILGOV 3.75 03/31/47	3,600,000.00	3,716,856.00	
	ILGOV 6.25 10/30/26	2,600,000.00	2,872,168.00	
	イスラエル・シュケル小計	14,100,000.00	14,023,163.00 (565,610,255)	
デンマーク・クローネ	DGB 0.25 11/15/52	1,800,000.00	1,151,784.00	
	DGB 0.5 11/15/27	8,000,000.00	7,419,520.00	
	DGB 0.5 11/15/29	4,800,000.00	4,306,560.00	
	DGB 1.5 11/15/23	1,900,000.00	1,890,291.00	
	DGB 1.75 11/15/25	3,600,000.00	3,565,080.00	
	DGB 4.5 11/15/39	8,200,000.00	10,976,356.00	
	デンマーク・クローネ小計	28,300,000.00	29,309,591.00 (565,968,201)	
ノル	NGB 1.375 08/19/30	4,200,000.00	3,701,502.00	

ウェー・ クローネ	NGB 1.5 02/19/26	3,000,000.00	2,833,980.00	
	NGB 1.75 03/13/25	3,000,000.00	2,891,730.00	
	NGB 1.75 09/06/29	4,700,000.00	4,309,524.00	
	NGB 2 04/26/28	5,900,000.00	5,561,222.00	
	NGB 3 03/14/24	2,800,000.00	2,784,656.00	
ノルウェー・クローネ小計		23,600,000.00	22,082,614.00	(306,948,335)
スウェー デン・ク ローナ	SGB 0.75 05/12/28	3,700,000.00	3,464,347.00	
	SGB 0.75 11/12/29	5,000,000.00	4,614,750.00	
	SGB 1 11/12/26	5,000,000.00	4,782,550.00	
	SGB 1.5 11/13/23	6,400,000.00	6,341,120.00	
	SGB 2.5 05/12/25	5,000,000.00	5,011,400.00	
	SGB 3.5 03/30/39	4,600,000.00	5,743,330.00	
スウェーデン・クローナ小計		29,700,000.00	29,957,497.00	(393,641,511)
メキシ コ・ペソ	MBONO 10 12/05/24	32,000,000.00	31,885,760.00	
	MBONO 5.75 03/05/26	19,000,000.00	16,992,840.00	
	MBONO 7.5 06/03/27	16,000,000.00	14,948,800.00	
	MBONO 7.75 05/29/31	21,000,000.00	19,226,550.00	
	MBONO 7.75 11/23/34	18,000,000.00	16,098,300.00	
	MBONO 8 11/07/47	5,000,000.00	4,417,350.00	
	MBONO 8 12/07/23	21,000,000.00	20,440,770.00	
	MBONO 8.5 05/31/29	18,000,000.00	17,371,980.00	
	MBONO 8.5 11/18/38	40,000,000.00	37,472,400.00	
メキシコ・ペソ小計		190,000,000.00	178,854,750.00	(1,291,724,774)
オフショ ア・人民 元	CGB 2.18 08/25/25	2,000,000.00	1,986,660.00	
	CGB 2.24 05/25/25	31,000,000.00	30,835,080.00	
	CGB 2.26 02/24/25	22,000,000.00	21,920,580.00	
	CGB 2.47 09/02/24	26,000,000.00	26,041,600.00	
	CGB 2.48 04/15/27	9,000,000.00	8,919,540.00	
	CGB 2.5 07/25/27	4,000,000.00	3,971,200.00	
	CGB 2.62 09/25/29	6,000,000.00	5,905,140.00	
	CGB 2.69 08/12/26	51,000,000.00	51,147,390.00	
	CGB 2.8 03/24/29	14,000,000.00	13,965,420.00	
	CGB 2.91 10/14/28	23,000,000.00	23,183,540.00	
	CGB 3.02 05/27/31	42,000,000.00	42,495,600.00	
	CGB 3.72 04/12/51	27,000,000.00	29,085,750.00	
オフショア・人民元小計		257,000,000.00	259,457,500.00	(5,037,419,254)
マレーシ ア・リン ギット	MALAYSIA GOVT	700,000.00	700,014.00	
	MALAYSIA GOVT	1,500,000.00	1,501,770.00	
	MALAYSIA GOVT	1,300,000.00	1,296,659.00	
	MALAYSIA GOVT	1,400,000.00	1,283,464.00	

	MGS 3.502 05/31/27	5,100,000.00	4,997,694.00	
	MGS 3.955 09/15/25	3,200,000.00	3,206,112.00	
	MGS 4.498 04/15/30	6,000,000.00	6,097,200.00	
	MGS 4.736 03/15/46	6,700,000.00	6,840,231.00	
	マレーシア・リングット小計	25,900,000.00	25,923,144.00 (798,165,827)	
ポーランド・ズロチ	POLGB 0.25 10/25/26	7,000,000.00	5,421,780.00	
	POLGB 0.75 04/25/25	1,800,000.00	1,568,070.00	
	POLGB 1.25 10/25/30	7,800,000.00	5,250,648.00	
	POLGB 2.25 10/25/24	8,000,000.00	7,347,920.00	
	POLGB 2.75 04/25/28	1,600,000.00	1,313,328.00	
	ポーランド・ズロチ小計	26,200,000.00	20,901,746.00 (641,932,333)	
ユーロ	BGB 0 10/22/31	1,300,000.00	1,055,132.00	
	BGB 0.1 06/22/30	200,000.00	170,142.00	
	BGB 0.35 06/22/32	300,000.00	246,096.00	
	BGB 0.4 06/22/40	300,000.00	203,697.00	
	BGB 0.5 10/22/24	1,300,000.00	1,262,170.00	
	BGB 0.65 06/22/71	400,000.00	200,148.00	
	BGB 0.8 06/22/25	300,000.00	290,799.00	
	BGB 0.8 06/22/27	800,000.00	752,784.00	
	BGB 0.8 06/22/28	1,600,000.00	1,486,912.00	
	BGB 0.9 06/22/29	900,000.00	826,380.00	
	BGB 1 06/22/26	1,800,000.00	1,732,428.00	
	BGB 1 06/22/31	1,300,000.00	1,168,180.00	
	BGB 1.25 04/22/33	1,100,000.00	981,552.00	
	BGB 1.45 06/22/37	400,000.00	340,480.00	
	BGB 1.6 06/22/47	650,000.00	521,995.50	
	BGB 1.7 06/22/50	500,000.00	403,985.00	
	BGB 1.9 06/22/38	1,000,000.00	898,630.00	
	BGB 2.15 06/22/66	500,000.00	449,325.00	
	BGB 2.25 06/22/57	500,000.00	459,725.00	
	BGB 2.6 06/22/24	400,000.00	402,864.00	
	BGB 3 06/22/34	200,000.00	207,776.00	
	BGB 3.75 06/22/45	800,000.00	934,232.00	
	BGB 4 03/28/32	500,000.00	564,090.00	
	BGB 4.25 03/28/41	1,000,000.00	1,213,260.00	
	BGB 4.5 03/28/26	700,000.00	754,320.00	
	BGB 5 03/28/35	1,000,000.00	1,246,290.00	
	BGB 5.5 03/28/28	1,100,000.00	1,285,867.00	
BTPS	2,400,000.00	2,296,320.00		
BTPS 0 12/15/24	1,300,000.00	1,235,962.00		
BTPS 0.35 02/01/25	2,400,000.00	2,282,976.00		
BTPS 0.5 02/01/26	1,000,000.00	924,700.00		

BTPS 0.85 01/15/27	1,700,000.00	1,556,945.00	
BTPS 0.9 04/01/31	2,000,000.00	1,617,800.00	
BTPS 0.95 06/01/32	1,500,000.00	1,175,265.00	
BTPS 0.95 08/01/30	1,800,000.00	1,487,610.00	
BTPS 0.95 09/15/27	800,000.00	722,720.00	
BTPS 0.95 12/01/31	2,600,000.00	2,065,154.00	
BTPS 1.1 04/01/27	1,800,000.00	1,654,056.00	
BTPS 1.25 12/01/26	800,000.00	747,504.00	
BTPS 1.45 03/01/36	400,000.00	302,676.00	
BTPS 1.45 05/15/25	700,000.00	678,622.00	
BTPS 1.45 11/15/24	1,800,000.00	1,762,434.00	
BTPS 1.5 06/01/25	1,900,000.00	1,839,333.00	
BTPS 1.6 06/01/26	1,200,000.00	1,144,332.00	
BTPS 1.65 12/01/30	2,200,000.00	1,910,282.00	
BTPS 1.7 09/01/51	1,500,000.00	980,700.00	
BTPS 1.85 05/15/24	1,500,000.00	1,483,470.00	
BTPS 1.85 07/01/25	1,000,000.00	973,620.00	
BTPS 2 02/01/28	3,200,000.00	3,015,232.00	
BTPS 2 12/01/25	1,300,000.00	1,265,472.00	
BTPS 2.05 08/01/27	1,500,000.00	1,430,265.00	
BTPS 2.1 07/15/26	1,000,000.00	968,740.00	
BTPS 2.2 06/01/27	900,000.00	867,177.00	
BTPS 2.25 09/01/36	500,000.00	417,810.00	
BTPS 2.45 09/01/33	1,100,000.00	962,368.00	
BTPS 2.45 09/01/50	900,000.00	694,530.00	
BTPS 2.5 11/15/25	1,200,000.00	1,186,992.00	
BTPS 2.5 12/01/24	1,300,000.00	1,296,750.00	
BTPS 2.7 03/01/47	1,550,000.00	1,288,685.50	
BTPS 2.8 03/01/67	600,000.00	468,696.00	
BTPS 2.8 12/01/28	1,600,000.00	1,557,264.00	
BTPS 2.95 09/01/38	600,000.00	532,080.00	
BTPS 3 08/01/29	3,100,000.00	3,027,987.00	
BTPS 3.1 03/01/40	500,000.00	447,620.00	
BTPS 3.25 09/01/46	1,500,000.00	1,369,140.00	
BTPS 3.35 03/01/35	850,000.00	801,847.50	
BTPS 3.45 03/01/48	1,000,000.00	940,210.00	
BTPS 3.5 03/01/30	3,400,000.00	3,416,898.00	
BTPS 3.75 09/01/24	2,300,000.00	2,343,700.00	
BTPS 3.85 09/01/49	1,100,000.00	1,100,506.00	
BTPS 4 02/01/37	2,600,000.00	2,643,290.00	
BTPS 4.5 03/01/24	1,000,000.00	1,023,400.00	
BTPS 4.5 03/01/26	1,800,000.00	1,884,852.00	
BTPS 4.75 09/01/28	2,000,000.00	2,150,640.00	
BTPS 4.75 09/01/44	800,000.00	894,688.00	

BTPS 5 03/01/25	1,000,000.00	1,049,730.00	
BTPS 5 08/01/34	2,070,000.00	2,278,614.60	
BTPS 5 08/01/39	1,800,000.00	2,029,230.00	
BTPS 5 09/01/40	1,700,000.00	1,928,123.00	
BTPS 5.75 02/01/33	1,700,000.00	1,974,805.00	
BTPS 6 05/01/31	2,200,000.00	2,595,890.00	
BTPS 6.5 11/01/27	1,700,000.00	1,960,933.00	
BTPS 7.25 11/01/26	400,000.00	463,912.00	
BTPS 9 11/01/23	300,000.00	317,535.00	
DBR 0 02/15/30	800,000.00	700,248.00	
DBR 0 02/15/32	3,200,000.00	2,694,400.00	
DBR 0 05/15/35	3,600,000.00	2,822,544.00	
DBR 0 08/15/29	2,500,000.00	2,209,700.00	
DBR 0 08/15/30	5,800,000.00	5,035,154.00	
DBR 0 08/15/31	1,500,000.00	1,277,805.00	
DBR 0 08/15/50	3,000,000.00	1,864,080.00	
DBR 0 11/15/27	1,300,000.00	1,186,302.00	
DBR 0.25 02/15/27	2,300,000.00	2,150,132.00	
DBR 0.25 02/15/29	1,800,000.00	1,631,952.00	
DBR 0.25 08/15/28	1,500,000.00	1,369,875.00	
DBR 0.5 02/15/25	2,500,000.00	2,421,775.00	
DBR 0.5 02/15/26	3,100,000.00	2,964,096.00	
DBR 0.5 02/15/28	2,100,000.00	1,958,754.00	
DBR 0.5 08/15/27	2,300,000.00	2,160,597.00	
DBR 1 05/15/38	1,000,000.00	870,030.00	
DBR 1 08/15/24	1,300,000.00	1,279,122.00	
DBR 1 08/15/25	1,300,000.00	1,267,643.00	
DBR 1.25 08/15/48	1,450,000.00	1,295,299.50	
DBR 1.5 05/15/24	2,200,000.00	2,183,984.00	
DBR 1.75 02/15/24	2,200,000.00	2,194,060.00	
DBR 2.5 07/04/44	1,900,000.00	2,113,712.00	
DBR 2.5 08/15/46	2,700,000.00	3,048,192.00	
DBR 3.25 07/04/42	700,000.00	849,450.00	
DBR 4 01/04/37	1,800,000.00	2,250,468.00	
DBR 4.25 07/04/39	700,000.00	921,431.00	
DBR 4.75 07/04/28	1,600,000.00	1,836,128.00	
DBR 4.75 07/04/34	600,000.00	775,248.00	
DBR 4.75 07/04/40	1,450,000.00	2,041,571.00	
DBR 5.5 01/04/31	900,000.00	1,138,635.00	
DBR 5.625 01/04/28	1,000,000.00	1,177,000.00	
DBR 6.25 01/04/24	1,200,000.00	1,256,784.00	
DBR 6.25 01/04/30	500,000.00	643,900.00	
DBR 6.5 07/04/27	1,000,000.00	1,197,180.00	
FRTR 0 02/25/24	400,000.00	389,704.00	

FRTR 0 02/25/25	3,000,000.00	2,856,300.00	
FRTR 0 02/25/26	3,800,000.00	3,544,716.00	
FRTR 0 03/25/24	4,800,000.00	4,667,280.00	
FRTR 0 03/25/25	1,900,000.00	1,806,292.00	
FRTR 0 05/25/32	1,900,000.00	1,526,479.00	
FRTR 0 11/25/29	4,500,000.00	3,862,440.00	
FRTR 0 11/25/30	3,900,000.00	3,266,328.00	
FRTR 0 11/25/31	3,000,000.00	2,449,680.00	
FRTR 0.25 11/25/26	3,200,000.00	2,972,064.00	
FRTR 0.5 05/25/25	1,300,000.00	1,248,078.00	
FRTR 0.5 05/25/26	3,500,000.00	3,307,045.00	
FRTR 0.5 05/25/29	2,300,000.00	2,064,572.00	
FRTR 0.5 05/25/72	100,000.00	46,611.00	
FRTR 0.5 06/25/44	800,000.00	528,608.00	
FRTR 0.75 02/25/28	500,000.00	464,360.00	
FRTR 0.75 05/25/28	3,300,000.00	3,055,965.00	
FRTR 0.75 05/25/52	3,000,000.00	1,897,500.00	
FRTR 0.75 11/25/28	3,500,000.00	3,217,760.00	
FRTR 1 05/25/27	1,800,000.00	1,711,980.00	
FRTR 1 11/25/25	1,000,000.00	967,280.00	
FRTR 1.25 05/25/34	1,200,000.00	1,048,008.00	
FRTR 1.25 05/25/36	3,700,000.00	3,136,120.00	
FRTR 1.5 05/25/31	2,550,000.00	2,410,158.00	
FRTR 1.5 05/25/50	2,400,000.00	1,890,096.00	
FRTR 1.75 05/25/66	800,000.00	642,352.00	
FRTR 1.75 06/25/39	3,200,000.00	2,857,408.00	
FRTR 1.75 11/25/24	2,600,000.00	2,577,510.00	
FRTR 2 05/25/48	2,000,000.00	1,767,880.00	
FRTR 2.25 05/25/24	1,700,000.00	1,701,666.00	
FRTR 2.5 05/25/30	3,500,000.00	3,578,330.00	
FRTR 2.75 10/25/27	3,850,000.00	3,956,568.00	
FRTR 3.25 05/25/45	900,000.00	992,106.00	
FRTR 3.5 04/25/26	2,500,000.00	2,608,150.00	
FRTR 4 04/25/55	1,370,000.00	1,765,505.30	
FRTR 4 04/25/60	1,400,000.00	1,839,656.00	
FRTR 4 10/25/38	2,000,000.00	2,346,780.00	
FRTR 4.5 04/25/41	2,100,000.00	2,652,279.00	
FRTR 4.75 04/25/35	2,200,000.00	2,700,588.00	
FRTR 5.5 04/25/29	2,350,000.00	2,806,088.00	
FRTR 5.75 10/25/32	400,000.00	519,368.00	
FRTR 6 10/25/25	2,100,000.00	2,325,792.00	
IRISH 0 10/18/31	500,000.00	408,270.00	
IRISH 0.9 05/15/28	500,000.00	466,650.00	
IRISH 1 05/15/26	800,000.00	772,160.00	

IRISH 1.1 05/15/29	500,000.00	465,630.00	
IRISH 1.3 05/15/33	800,000.00	715,936.00	
IRISH 1.35 03/18/31	500,000.00	466,960.00	
IRISH 1.5 05/15/50	500,000.00	396,295.00	
IRISH 1.7 05/15/37	300,000.00	268,215.00	
IRISH 2 02/18/45	900,000.00	804,645.00	
IRISH 2.4 05/15/30	600,000.00	607,800.00	
IRISH 3.4 03/18/24	500,000.00	508,740.00	
IRISH 5.4 03/13/25	800,000.00	858,040.00	
NETHER 0 01/15/24	500,000.00	488,540.00	
NETHER 0 01/15/27	800,000.00	736,584.00	
NETHER 0 07/15/30	2,600,000.00	2,224,950.00	
NETHER 0.25 07/15/25	1,100,000.00	1,050,973.00	
NETHER 0.25 07/15/29	1,000,000.00	887,380.00	
NETHER 0.5 01/15/40	1,700,000.00	1,298,715.00	
NETHER 0.5 07/15/26	1,700,000.00	1,611,277.00	
NETHER 0.5 07/15/32	200,000.00	171,066.00	
NETHER 0.75 07/15/27	400,000.00	377,944.00	
NETHER 0.75 07/15/28	1,500,000.00	1,398,360.00	
NETHER 2 07/15/24	700,000.00	699,524.00	
NETHER 2.5 01/15/33	200,000.00	205,524.00	
NETHER 2.75 01/15/47	1,500,000.00	1,705,575.00	
NETHER 3.75 01/15/42	1,300,000.00	1,623,037.00	
NETHER 4 01/15/37	1,400,000.00	1,697,080.00	
NETHER 5.5 01/15/28	700,000.00	815,787.00	
OBL 0 04/05/24	1,300,000.00	1,265,901.00	
OBL 0 04/11/25	2,800,000.00	2,673,384.00	
OBL 0 04/16/27	3,300,000.00	3,038,112.00	
OBL 0 10/09/26	1,100,000.00	1,021,350.00	
OBL 0 10/10/25	1,800,000.00	1,704,078.00	
OBL 0 10/18/24	600,000.00	577,878.00	
RAGB 0 02/20/30	900,000.00	759,168.00	
RAGB 0 02/20/31	900,000.00	738,279.00	
RAGB 0.5 02/20/29	550,000.00	493,564.50	
RAGB 0.5 04/20/27	700,000.00	651,770.00	
RAGB 0.75 02/20/28	700,000.00	650,811.00	
RAGB 0.75 03/20/51	900,000.00	596,583.00	
RAGB 0.75 10/20/26	1,300,000.00	1,236,313.00	
RAGB 0.85 06/30/20	150,000.00	76,227.00	
RAGB 0.9 02/20/32	300,000.00	260,925.00	
RAGB 1.2 10/20/25	1,000,000.00	976,010.00	
RAGB 1.5 02/20/47	700,000.00	575,967.00	
RAGB 1.5 11/02/86	200,000.00	142,294.00	
RAGB 1.65 10/21/24	800,000.00	792,840.00	

RAGB 2.4 05/23/34	900,000.00	889,587.00	
RAGB 3.15 06/20/44	500,000.00	553,400.00	
RAGB 3.8 01/26/62	700,000.00	914,879.00	
RAGB 4.15 03/15/37	300,000.00	354,678.00	
RAGB 4.85 03/15/26	500,000.00	543,860.00	
RAGB 6.25 07/15/27	1,000,000.00	1,180,940.00	
RFGB 0.25 09/15/40	400,000.00	269,988.00	
RFGB 0.5 04/15/26	700,000.00	663,152.00	
RFGB 0.5 09/15/28	400,000.00	361,236.00	
RFGB 0.5 09/15/29	800,000.00	708,016.00	
RFGB 0.75 04/15/31	500,000.00	437,180.00	
RFGB 1.375 04/15/47	500,000.00	412,785.00	
RFGB 2 04/15/24	900,000.00	899,334.00	
RFGB 2.625 07/04/42	800,000.00	813,080.00	
RFGB 2.75 07/04/28	400,000.00	410,100.00	
RFGB 4 07/04/25	300,000.00	314,898.00	
SPGB 0 01/31/25	500,000.00	476,655.00	
SPGB 0.25 07/30/24	1,400,000.00	1,355,522.00	
SPGB 0.5 04/30/30	1,000,000.00	858,010.00	
SPGB 0.5 10/31/31	1,400,000.00	1,151,178.00	
SPGB 0.7 04/30/32	2,200,000.00	1,818,718.00	
SPGB 0.8 07/30/27	1,000,000.00	927,670.00	
SPGB 1 10/31/50	300,000.00	181,035.00	
SPGB 1.2 10/31/40	1,700,000.00	1,235,152.00	
SPGB 1.25 10/31/30	3,000,000.00	2,697,450.00	
SPGB 1.3 10/31/26	3,100,000.00	2,982,603.00	
SPGB 1.4 04/30/28	1,600,000.00	1,509,936.00	
SPGB 1.4 07/30/28	2,200,000.00	2,070,046.00	
SPGB 1.45 04/30/29	1,600,000.00	1,496,272.00	
SPGB 1.45 10/31/27	1,100,000.00	1,048,839.00	
SPGB 1.45 10/31/71	400,000.00	224,804.00	
SPGB 1.5 04/30/27	1,500,000.00	1,443,900.00	
SPGB 1.6 04/30/25	1,400,000.00	1,379,798.00	
SPGB 1.85 07/30/35	2,000,000.00	1,754,980.00	
SPGB 1.95 04/30/26	2,000,000.00	1,976,280.00	
SPGB 1.95 07/30/30	1,700,000.00	1,616,904.00	
SPGB 2.15 10/31/25	1,600,000.00	1,596,848.00	
SPGB 2.35 07/30/33	700,000.00	665,308.00	
SPGB 2.7 10/31/48	750,000.00	686,677.50	
SPGB 2.75 10/31/24	2,100,000.00	2,119,698.00	
SPGB 2.9 10/31/46	1,700,000.00	1,630,861.00	
SPGB 3.45 07/30/66	1,300,000.00	1,344,980.00	
SPGB 3.8 04/30/24	1,400,000.00	1,430,254.00	
SPGB 4.2 01/31/37	1,250,000.00	1,411,762.50	

	SPGB 4.4 10/31/23	1,000,000.00	1,018,950.00	
	SPGB 4.65 07/30/25	1,300,000.00	1,380,561.00	
	SPGB 4.7 07/30/41	1,500,000.00	1,829,325.00	
	SPGB 4.8 01/31/24	2,200,000.00	2,266,484.00	
	SPGB 4.9 07/30/40	1,200,000.00	1,486,596.00	
	SPGB 5.15 10/31/28	1,500,000.00	1,710,345.00	
	SPGB 5.15 10/31/44	1,000,000.00	1,312,820.00	
	SPGB 5.75 07/30/32	1,000,000.00	1,254,440.00	
	SPGB 5.9 07/30/26	500,000.00	563,395.00	
	SPGB 6 01/31/29	2,200,000.00	2,636,348.00	
	ユーロ小計	373,740,000.00	360,499,684.40 (51,760,544,686)	
	国債証券合計		151,679,008,052 (151,679,008,052)	
	合計		151,679,008,052 (151,679,008,052)	

(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	207銘柄	49.6%	50.5%
カナダ・ドル	国債証券	21銘柄	2.0%	2.1%
オーストラリア・ドル	国債証券	18銘柄	1.5%	1.6%
シンガポール・ドル	国債証券	10銘柄	0.5%	0.5%
ニュージーランド・ドル	国債証券	6銘柄	0.2%	0.2%
イギリス・ポンド	国債証券	45銘柄	4.7%	4.8%
イスラエル・シケル	国債証券	6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	6銘柄	0.2%	0.2%
スウェーデン・クローナ	国債証券	6銘柄	0.3%	0.3%
メキシコ・ペソ	国債証券	9銘柄	0.8%	0.9%
オフショア・人民元	国債証券	12銘柄	3.3%	3.3%
マレーシア・リングgit	国債証券	8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	33.6%	34.1%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2021年11月30日現在)	(2022年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		

預金	27,046,991	78,573,387
金銭信託	1,124,192	2,587,805
コール・ローン	33,156,127	15,966,983
国債証券	1,001,457,353	2,894,688,630
派生商品評価勘定	45,617	21,511
未収利息	5,539,151	25,080,637
前払費用	4,001,235	6,190,809
流動資産合計	1,072,370,666	3,023,109,762
資産合計	1,072,370,666	3,023,109,762
負債の部		
流動負債		
未払金	26,565,295	-
その他未払費用	90	59
流動負債合計	26,565,385	59
負債合計	26,565,385	59
純資産の部		
元本等		
元本	1,047,048,040	3,247,890,526
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	1,242,759	224,780,823
元本等合計	1,045,805,281	3,023,109,703
純資産合計	1,045,805,281	3,023,109,703
負債純資産合計	1,072,370,666	3,023,109,762

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年11月30日現在)	(2022年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,047,048,040口	3,247,890,526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 1,242,759円	元本の欠損 224,780,823円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9988円 (1万口当たりの純資産額9,988円)	1口当たり純資産額 0.9308円 (1万口当たりの純資産額9,308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12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、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。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

		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	32,946,900	-	32,992,517	45,617
	小計	32,946,900	-	32,992,517	45,617
合計		32,946,900	-	32,992,517	45,617

(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	9,698,080	-	9,719,591	21,511
	小計	9,698,080	-	9,719,591	21,511
合計		9,698,080	-	9,719,591	21,511

(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12月1日 至 2022年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2021年11月30日現在)	
開示対象ファンドの 期首における当該親投資信託の元本額	499,583,536円

同期中における追加設定元本額	555,508,748円
同期中における一部解約元本額	8,044,244円
2021年11月30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）	639,603,666円
日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジなし）	405,849,697円
三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド	1,594,677円
合計	1,047,048,040円

(2022年11月30日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	1,047,048,040円
同期中における追加設定元本額	2,892,281,882円
同期中における一部解約元本額	691,439,396円
2022年11月30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）	391,617,618円
日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジなし）	1,945,147,099円
三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド	12,227,737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）	296,532,241円
合計	3,247,890,526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	ADGB 1.875 09/15/31	1,300,000.00	1,080,768.00	
		ADGB 2.5 04/16/25	500,000.00	479,980.00	
		ADGB 3.125 09/30/49	500,000.00	370,640.00	
		BRAZIL 2.875 06/06/25	600,000.00	566,184.00	
		BRAZIL 3.875 06/12/30	500,000.00	435,160.00	
		BRAZIL 4.75 01/14/50	200,000.00	145,020.00	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	200,000.00	173,202.00	
		CHILE 2.55 07/27/33	600,000.00	481,320.00	
		CHILE 2.75 01/31/27	400,000.00	371,256.00	
		CHILE 3.1 05/07/41	200,000.00	146,970.00	
		CHILE 3.5 01/25/50	200,000.00	148,754.00	
		CHILE 4.34 03/07/42	400,000.00	342,164.00	
		CHINA (PEOPLE'S)	200,000.00	164,024.00	
		CHINA 0.55 10/21/25	200,000.00	179,334.00	
		CHINA 1.25 10/26/26	700,000.00	630,700.00	

COLOM 3.125 04/15/31	600,000.00	438,960.00	
DOMREP 5.5 02/22/29	200,000.00	183,454.00	
DOMREP 5.875 01/30/60	600,000.00	440,706.00	
DOMREP 6 02/22/33	800,000.00	716,544.00	
INDON 3.05 03/12/51	200,000.00	143,498.00	
INDON 3.85 10/15/30	200,000.00	187,956.00	
INDON 4.75 01/08/26	200,000.00	198,400.00	
INDON 5.125 01/15/45	400,000.00	386,712.00	
KSA 2.25 02/02/33	1,400,000.00	1,139,474.00	
KSA 3.625 03/04/28	600,000.00	573,894.00	
KSA 5.25 01/16/50	200,000.00	196,368.00	
MEX 2.659 05/24/31	1,200,000.00	995,856.00	
MEX 4.5 01/31/50	300,000.00	240,225.00	
MEX 5 04/27/51	900,000.00	765,738.00	
OMAN 6 08/01/29	400,000.00	397,464.00	
OMAN 6.25 01/25/31	1,000,000.00	1,000,600.00	
PANAMA 2.252 09/29/32	600,000.00	451,920.00	
PANAMA 4.5 01/19/63	800,000.00	583,856.00	
PERU 2.783 01/23/31	800,000.00	673,776.00	
PERU 5.625 11/18/50	200,000.00	199,122.00	
PHILIP 1.648 06/10/31	200,000.00	159,528.00	
PHILIP 2.95 05/05/45	200,000.00	145,498.00	
PHILIP 3.7 02/02/42	200,000.00	163,730.00	
QATAR 3.4 04/16/25	200,000.00	195,366.00	
QATAR 3.75 04/16/30	1,100,000.00	1,061,742.00	
QATAR 4.4 04/16/50	900,000.00	828,216.00	
SOAF 4.85 09/30/29	400,000.00	363,496.00	
SOAF 5.75 09/30/49	300,000.00	227,952.00	
SOAF 5.875 06/22/30	400,000.00	379,936.00	
TURKEY 6.125 10/24/28	800,000.00	712,712.00	
TURKEY 6.375 10/14/25	400,000.00	384,656.00	
URUGUA 4.375 01/23/31	400,000.00	400,632.00	
URUGUA 4.975 04/20/55	200,000.00	191,130.00	
アメリカ・ドル小計	24,000,000.00	20,844,593.00 (2,894,688,630)	
国債証券合計		2,894,688,630 (2,894,688,630)	
合計		2,894,688,630 (2,894,688,630)	

(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 48銘柄	95.8%	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。

Jリート・インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2021年11月30日現在)	(2022年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	4,726,735	16,783,253
コール・ローン	139,406,953	103,554,152
投資証券	8,552,350,950	10,443,009,900
未収配当金	47,699,981	61,307,439
前払金	2,534,000	592,000
差入委託証拠金	1,930,000	2,300,000
流動資産合計	8,748,648,619	10,627,546,744
資産合計	8,748,648,619	10,627,546,744
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,918,400	746,400
未払金	69,676,777	60,516,485
未払解約金	9,270,489	2,127,632
その他未払費用	1,079	441
流動負債合計	81,866,745	63,390,958
負債合計	81,866,745	63,390,958
純資産の部		
元本等		
元本	3,284,744,165	3,913,179,470
剰余金		
剰余金又は欠損金()	5,382,037,709	6,650,976,316
元本等合計	8,666,781,874	10,564,155,786
純資産合計	8,666,781,874	10,564,155,786
負債純資産合計	8,748,648,619	10,627,546,744

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	（2021年11月30日現在）	（2022年11月30日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	3,284,744,165口	3,913,179,470口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.6385円 （1万口当たりの純資産額26,385円）	1口当たり純資産額 2.6996円 （1万口当たりの純資産額26,996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12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、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</p> <p>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、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11月30日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券（投資証券）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p>

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	リート指数先物取引 買建				
	TREIT先物0312月	42,968,400	-	40,050,000	2,918,400
	小計	42,968,400	-	40,050,000	2,918,400
合計		42,968,400	-	40,050,000	2,918,400

(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	リート指数先物取引 買建				
	TREIT先物0412月	40,146,400	-	39,400,000	746,400
	小計	40,146,400	-	39,400,000	746,400
合計		40,146,400	-	39,400,000	746,400

(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。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2021年11月30日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	2,771,760,223円
同期中における追加設定元本額	791,184,769円
同期中における一部解約元本額	278,200,827円
2021年11月30日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	148,899,827円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	246,919,552円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	162,217,084円
イオン・バランス戦略ファンド	19,849,872円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	1,775,302,683円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	12,694,289円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	48,810,703円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	35,714,617円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	116,382,487円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	62,651,196円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	48,724,686円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	20,933,583円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,714,624円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	49,584,329円
日興FWS・Jリートインデックス	96,669,288円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	812,567円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	4,569,920円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	23,646,493円
SMAM・年金WRリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	59,278,592円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	79,044,868円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	85,607,210円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%)<適格機関投資家限定>	184,715,695円
合計	3,284,744,165円

(2022年11月30日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	3,284,744,165円
同期中における追加設定元本額	2,347,844,703円
同期中における一部解約元本額	1,719,409,398円
2022年11月30日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	123,734,117円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	226,924,020円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	145,809,464円
イオン・バランス戦略ファンド	20,352,708円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	2,243,436,891円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	18,736,291円

三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	60,011,376円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	46,032,543円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	162,453,627円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	92,074,182円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	72,660,790円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	30,209,555円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,455,740円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	167,299,338円
日興FWS・Jリートインデックス	374,896,546円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	43,763,199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>	3,324,665円
SMAM・年金WRリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	28,778,069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>	3,208,159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>	4,273,982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>	42,744,208円
合計	3,913,179,470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	189	22,434,300	
	サンケイリアルエステート	300	27,930,000	
	SOSILA物流リート投	435	59,769,000	
	SOSILA物流リート新	13	1,786,200	
	東海道リート投資法	112	13,652,800	
	日本アコモデーションF	328	205,656,000	
	森ヒルズリート	1,117	180,395,500	
	産業ファンド	1,421	226,081,100	
	アドバンス・レジデンス	950	326,800,000	
	ケネディクスレジデンシャル	681	142,260,900	
	API投資法人	501	213,927,000	
	GLP投資法人	3,065	472,010,000	
	コンフォリア・レジデンシャル	442	139,451,000	
	日本プロロジスリート	1,556	525,150,000	
	星野リゾート・リート	167	115,063,000	
	ONEリート投資法人	165	41,728,500	
	イオンリート投資	1,053	168,058,800	
	ヒューリックリート投資法	890	153,436,000	
	日本リート投資法人	308	112,728,000	
	積水ハウス・リート投資	2,872	231,196,000	
トーセイ・リート投資法人	207	27,696,600		

ケネディクス商業リート	412	109,427,200	
ヘルスケア&メディカル投資	233	44,060,300	
サムティ・レジデンシャル	219	26,258,100	
野村不動産マスターF	3,071	529,747,500	
いちごホテルリート投資	153	15,682,500	
ラサールロジポート投資	1,164	187,753,200	
スターアジア不動産投	1,186	66,297,400	
マリモ地方創生リート	116	15,822,400	
三井不ロジパーク	375	187,312,500	
大江戸温泉リート	148	9,472,000	
投資法人みらい	1,163	54,544,700	
森トラスト・ホテルリート投	219	29,608,800	
三菱地所物流REIT	326	143,603,000	
CREロジスティクスファンド	366	75,139,800	
ザイマックス・リート	151	18,301,200	
タカラレーベン不動産投	417	43,284,600	
アドバンス・ロジスティクス	412	60,522,800	
日本ビルファンド	1,107	708,480,000	
ジャパンリアルエステイト	949	577,941,000	
日本都市ファンド	4,791	527,489,100	
オリックス不動産投資	1,893	366,295,500	
日本プライムリアルティ	650	255,450,000	
NTT都市開発リート投	915	134,962,500	
東急リアル・エステート	638	137,552,800	
グローバル・ワン不動産	646	69,251,200	
グローバル・ワン不動新	26	2,787,200	
ユナイテッドアーバン投資	2,126	327,829,200	
森トラスト総合リート	680	99,824,000	
インヴィンシブル投資法	4,186	199,462,900	
フロンティア不動産投資	352	186,208,000	
平和不動産リート	651	104,876,100	
日本ロジスティクス F	641	205,440,500	
福岡リート	488	85,058,400	
ケネディクス・オフィス投資	553	186,637,500	
いちごオフィスリート投	783	67,103,100	
大和証券オフィス投資	195	132,015,000	
阪急阪神リート	429	65,508,300	
スターツプロシード投資	163	38,174,600	
大和ハウスリート	1,431	440,032,500	
ジャパン・ホテル・リート	3,066	229,030,200	
大和証券リビング投	1,291	152,338,000	
ジャパンエクセレント投資	874	119,213,600	
投資証券 小計		10,443,009,900	
合計		10,443,009,900	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

外国リート・インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2021年11月30日現在)	(2022年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	99,344,009	179,631,581
金銭信託	2,954,229	25,566,164
コール・ローン	87,129,944	157,745,488
投資証券	17,620,715,349	24,586,639,159
派生商品評価勘定	13,752	1,047
未収入金	865,289	1,170,969
未収配当金	22,724,956	39,192,137
流動資産合計	17,833,747,528	24,989,946,545
資産合計	17,833,747,528	24,989,946,545
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,782	170,425
未払金	-	78,556,684
未払解約金	-	31,589,177
その他未払費用	482	371
流動負債合計	4,264	110,316,657
負債合計	4,264	110,316,657
純資産の部		
元本等		
元本	6,336,539,299	8,860,732,746
剰余金		
剰余金又は欠損金()	11,497,203,965	16,018,897,142
元本等合計	17,833,743,264	24,879,629,888
純資産合計	17,833,743,264	24,879,629,888
負債純資産合計	17,833,747,528	24,989,946,545

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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>(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11月30日現在）	（2022年11月30日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	6,336,539,299口	8,860,732,746口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.8144円 （1万口当たりの純資産額28,144円）	1口当たり純資産額 2.8079円 （1万口当たりの純資産額28,079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12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容 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</p> <p>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
<p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>金融商品の時価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11月30日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券（投資証券）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p>

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	69,000,000	-	69,002,662	2,662
	カナダ・ドル	1,500,000	-	1,499,857	143
	オーストラリア・ドル	4,800,000	-	4,806,426	6,426
	シンガポール・ドル	2,300,000	-	2,304,664	4,664
	イギリス・ポンド	4,300,000	-	4,296,374	3,626
	ユーロ	3,200,000	-	3,199,987	13
	小計	85,100,000	-	85,109,970	9,970
合 計		85,100,000	-	85,109,970	9,970

(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	130,100,000	-	130,003,672	96,328
	オーストラリア・ドル	14,300,000	-	14,243,620	56,380
	シンガポール・ドル	2,300,000	-	2,300,972	972
	イギリス・ポンド	1,800,000	-	1,782,358	17,642
	小計	148,500,000	-	148,330,622	169,378
合 計		148,500,000	-	148,330,622	169,378

(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12月1日 至 2022年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2021年11月30日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	5,762,256,649円
同期中における追加設定元本額	741,440,225円
同期中における一部解約元本額	167,157,575円
2021年11月30日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	19,396,868円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	21,022,305円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	15,960,970円
イオン・バランス戦略ファンド	50,669,415円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	5,353,435,552円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2050	4,309,173円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	47,287,876円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	34,006,806円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	110,231,658円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	59,478,823円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	46,479,633円
三井住友・DCつみたてN I S A ・世界分散ファンド	60,151,937円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2060	593,880円
三井住友D S ・外国リートインデックス年金ファンド	105,121,312円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	29,066,138円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	88,855,201円
三井住友D S ・先進国リートインデックス・ファンド	819,793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>	49,064,588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>	27,536,734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>	36,234,944円

SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%)<適格機関投資家限定>	176,815,693円
合計	6,336,539,299円

(2022年11月30日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	6,336,539,299円
同期中における追加設定元本額	3,494,346,976円
同期中における一部解約元本額	970,153,529円
2022年11月30日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	12,940,527円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	17,073,331円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	12,567,990円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	7,380,775,925円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	6,434,883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)	44,014,413円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	153,929,966円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	87,821,388円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	69,286,976円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	89,559,984円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	845,457円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド	325,259,559円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	78,592,105円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	387,230,766円
三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド	31,002,495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>	36,000,406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>	31,377,238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>	37,412,735円
合計	8,860,732,746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	14,653.00	222,725.60	
		AGREE REALTY CORP	11,040.00	762,201.60	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	8,514.00	165,597.30	
		ALEXANDER'S INC	300.00	73,371.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	20,661.00	3,151,215.72	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	2,165.00	41,524.70	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	7,000.00	199,220.00	

AMERICAN HOMES 4 RENT- A	40,800.00	1,326,408.00	
AMERICOLD REALTY TRUST INC	36,548.00	1,078,531.48	
APARTMENT INCOME REIT CO	21,100.00	783,865.00	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	23,200.00	187,224.00	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	28,200.00	474,324.00	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	8,429.00	100,220.81	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	2,515.00	15,919.95	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	19,520.00	3,333,820.80	
BLUEROCK HOMES TRUST INC	468.00	11,695.32	
BOSTON PROPERTIES INC	20,247.00	1,431,260.43	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	8,400.00	30,324.00	
BRANDYWINE REALTY TRUST	20,191.00	136,894.98	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	41,500.00	956,575.00	
BROADSTONE NET LEASE INC	23,684.00	392,917.56	
BRT APARTMENTS CORP	500.00	10,105.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	14,475.00	1,704,431.25	
CARETRUST REIT INC	13,303.00	260,472.74	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	3,648.00	106,339.20	
CENTERSPACE	2,600.00	165,360.00	
CHATHAM LODGING TRUST	5,557.00	72,796.70	
CITY OFFICE REIT INC	4,603.00	45,017.34	
CLIPPER REALTY INC	800.00	5,864.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3,216.00	110,952.00	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	16,866.00	461,622.42	
COUSINS PROPERTIES INC	20,011.00	519,885.78	
CTO REALTY GROWTH INC	3,839.00	81,194.85	
CUBESMART	31,063.00	1,229,473.54	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	33,165.00	304,123.05	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	69,000.00	40,710.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	39,776.00	4,325,640.00	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	23,884.00	24,122.84	
DOUGLAS EMMETT INC	23,532.00	397,455.48	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	20,000.00	2,740.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	11,869.00	190,260.07	
EASTGROUP PROPERTIES INC	5,919.00	899,747.19	
ELME COMMUNITIES	10,790.00	207,491.70	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	21,276.00	162,548.64	
EPR PROPERTIES	11,259.00	459,029.43	
EQUINIX INC	12,620.00	8,467,515.20	
EQUITY COMMONWEALTH	14,758.00	394,186.18	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	23,766.00	1,555,009.38	
EQUITY RESIDENTIAL	47,128.00	2,996,398.24	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	19,710.00	446,825.70	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	8,849.00	1,898,022.01	

EXTRA SPACE STORAGE INC	18,533.00	2,845,186.16	
FARMLAND PARTNERS INC	4,666.00	61,404.56	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	10,122.00	1,114,027.32	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	18,640.00	919,511.20	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	11,500.00	306,820.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	15,115.00	44,589.25	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	35,357.00	1,823,360.49	
GETTY REALTY CORP	5,036.00	164,475.76	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5,368.00	99,630.08	
GLADSTONE LAND CORP	4,464.00	90,083.52	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	5,669.00	55,726.27	
GLOBAL NET LEASE INC	13,146.00	173,527.20	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	51,300.00	1,022,409.00	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	76,084.00	1,950,793.76	
HERSHA HOSPITALITY TRUST-A	2,876.00	27,293.24	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	13,846.00	405,549.34	
HOST HOTELS & RESORTS INC	99,100.00	1,849,206.00	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	17,289.00	194,328.36	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	32,400.00	568,944.00	
INDUS REALTY TRUST INC	823.00	52,540.32	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	6,274.00	25,033.26	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,822.00	450,422.70	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	8,406.00	208,636.92	
INVITATION HOMES INC	81,180.00	2,591,265.60	
IRON MOUNTAIN INC	40,229.00	2,166,733.94	
ISTAR INC	13,800.00	136,620.00	
JBG SMITH PROPERTIES	14,792.00	297,319.20	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	130,900.00	71,340.50	
KILROY REALTY CORP	14,505.00	608,049.60	
KIMCO REALTY CORP	85,800.00	1,949,376.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	30,324.00	681,986.76	
LIFE STORAGE INC	11,350.00	1,174,384.50	
LTC PROPERTIES INC	5,036.00	196,555.08	
LXP INDUSTRIAL TRUST	37,000.00	387,020.00	
MACERICH CO/THE	30,200.00	391,694.00	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	245,900.00	92,212.50	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	80,900.00	1,050,082.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	16,150.00	2,615,008.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	24,625.00	1,115,512.50	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	11,732.00	452,033.96	
NATL HEALTH INVESTORS INC	6,051.00	332,260.41	
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	17,023.00	112,181.57	
NETSTREIT CORP	8,448.00	164,567.04	
NEXPOINT RESIDENTIAL	3,529.00	164,910.17	

OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	5,071.00	77,332.75	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	33,565.00	1,009,635.20	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,352.00	55,765.92	
ORION OFFICE REIT INC	5,199.00	47,570.85	
PARAMOUNT GROUP INC	20,155.00	128,790.45	
PARK HOTELS & RESORTS INC	31,179.00	385,684.23	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	17,544.00	284,212.80	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	15,254.00	486,907.68	
PHYSICIANS REALTY TRUST	31,204.00	450,585.76	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	19,902.00	204,592.56	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,774.00	96,243.84	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	1,424.00	21,801.44	
PRIME US REIT	130,700.00	61,429.00	
PROLOGIS INC	127,900.00	14,556,299.00	
PUBLIC STORAGE	21,939.00	6,375,473.40	
REALTY INCOME CORP	86,021.00	5,359,108.30	
REGENCY CENTERS CORP	21,400.00	1,408,548.00	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	16,432.00	248,780.48	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	24,010.00	1,298,460.80	
RLJ LODGING TRUST	24,132.00	287,170.80	
RPT REALTY	11,788.00	131,082.56	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	7,817.00	701,732.09	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	32,679.00	421,559.10	
SAFEHOLD INC	2,310.00	66,181.50	
SAUL CENTERS INC	2,331.00	98,834.40	
SERVICE PROPERTIES TRUST	25,446.00	194,152.98	
SIMON PROPERTY GROUP INC	45,601.00	5,356,293.46	
SITE CENTERS CORP	26,013.00	349,874.85	
SL GREEN REALTY CORP	9,537.00	396,929.94	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	18,892.00	768,904.40	
STAG INDUSTRIAL INC	24,351.00	777,040.41	
STORE CAPITAL CORP	36,400.00	1,157,884.00	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	14,098.00	119,269.08	
SUN COMMUNITIES INC	17,270.00	2,500,868.70	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	29,379.00	316,705.62	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	15,336.00	298,745.28	
TERRENO REALTY CORP	8,800.00	506,000.00	
UDR INC	42,269.00	1,722,461.75	
UMH PROPERTIES INC	6,284.00	110,221.36	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,344.00	69,619.20	
URBAN EDGE PROPERTIES	15,028.00	235,037.92	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	2,927.00	54,822.71	
VENTAS INC	56,111.00	2,547,439.40	
VERIS RESIDENTIAL INC	10,798.00	170,716.38	

	VICI PROPERTIES INC	133,286.00	4,487,739.62	
	VORNADO REALTY TRUST	21,846.00	552,922.26	
	WELLTOWER INC	64,600.00	4,470,320.00	
	WHITESTONE REIT	4,511.00	43,215.38	
	WP CAREY INC	29,170.00	2,281,677.40	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	15,327.00	230,977.89	
	アメリカ・ドル小計	3,617,933.00	137,609,412.12 (19,109,819,061)	
カナダ・ ドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	8,800.00	233,376.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	9,662.00	90,049.84	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	2,725.00	31,010.50	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,190.00	159,723.30	
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	2,642.00	50,382.94	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	13,622.00	51,763.60	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	11,424.00	494,659.20	
	CHOICE PROPERTIES REIT	23,858.00	348,088.22	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	5,107.00	83,346.24	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	4,551.00	71,359.68	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	17,899.00	216,398.91	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,465.00	84,434.25	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	11,377.00	36,975.25	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	14,775.00	253,686.75	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4,448.00	356,551.68	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	16,425.00	204,984.00	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	1,387.00	6,199.89	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11,198.00	138,631.24	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	8,107.00	135,630.11	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,447.00	21,039.38	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1,557.00	25,612.65	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	4,345.00	45,535.60	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	20,754.00	210,238.02	
	PRIMARIS REIT	6,318.00	96,349.50	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	19,525.00	415,296.75	
	SLATE GROCERY REIT-CL U	3,196.00	50,081.32	
SLATE OFFICE REIT	3,663.00	16,593.39		
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	9,440.00	260,638.40		
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	13,800.00	310,500.00		
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4,770.00	28,715.40		
	カナダ・ドル小計	265,477.00	4,527,852.01 (462,565,361)	
オースト ラリア・ ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	50,980.00	137,646.00	
	ARENA REIT	45,981.00	177,946.47	
	BWP TRUST	66,965.00	274,556.50	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	104,758.00	196,945.04	

	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	84,443.00	269,373.17	
	CENTURIA OFFICE REIT	43,559.00	69,258.81	
	CHARTER HALL GROUP	64,246.00	873,103.14	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	97,225.00	427,790.00	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	62,449.00	253,542.94	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	37,955.00	127,149.25	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	158,718.00	111,896.19	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	30,237.00	87,384.93	
	DEXUS/AU	152,720.00	1,200,379.20	
	GDI PROPERTY GROUP	43,204.00	32,835.04	
	GOODMAN GROUP	236,100.00	4,412,709.00	
	GPT GROUP	273,000.00	1,193,010.00	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	30,439.00	98,013.58	
	HEALTHCO REIT	51,410.00	81,741.90	
	HMC CAPITAL LTD	33,678.00	174,452.04	
	HOMEKO DAILY NEEDS REIT	187,797.00	245,075.08	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	25,921.00	86,057.72	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	39,965.00	170,650.55	
	MIRVAC GROUP	534,373.00	1,186,308.06	
	NATIONAL STORAGE REIT	162,000.00	388,800.00	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	89,106.00	65,938.44	
	REGION RE LTD	143,852.00	394,154.48	
	RURAL FUNDS GROUP	52,739.00	135,011.84	
	SCENTRE GROUP	734,000.00	2,157,960.00	
	STOCKLAND	339,500.00	1,290,100.00	
	VICINITY CENTRES	530,100.00	1,076,103.00	
	WAYPOINT REIT	113,111.00	311,055.25	
	オーストラリア・ドル小計	4,620,531.00	17,706,947.62 (1,643,027,670)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	239,000.00	650,080.00	
	FORTUNE REIT	208,000.00	1,154,400.00	
	LINK REIT	294,700.00	15,501,220.00	
	PROSPERITY REIT	178,000.00	313,280.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	110,000.00	328,900.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	293,000.00	542,050.00	
	香港・ドル小計	1,322,700.00	18,489,930.00 (328,750,954)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT	113,300.00	139,359.00	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	456,600.00	1,260,216.00	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	260,055.00	245,751.97	
	CAPITALAND CHINA TRUST	205,700.00	215,985.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	721,208.00	1,500,112.64	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	94,950.00	113,940.00	
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	44,500.00	28,480.00	

	EC WORLD REIT	52,800.00	23,496.00	
	ESR-LOGOS REIT	864,913.00	302,719.55	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	190,000.00	116,850.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	176,400.00	43,218.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	141,800.00	289,272.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	370,238.00	414,666.56	
	KEPPEL DC REIT	170,900.00	317,874.00	
	KEPPEL REIT	275,800.00	248,220.00	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	262,000.00	189,950.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	273,200.00	617,432.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	432,950.00	697,049.50	
	MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	304,700.00	527,131.00	
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT	243,200.00	85,120.00	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	48,000.00	185,280.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT	66,700.00	50,692.00	
	SPH REIT	115,700.00	104,130.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	138,200.00	76,701.00	
	SUNTEC REIT	324,800.00	448,224.00	
	シンガポール・ドル小計	6,348,614.00	8,241,870.22 (832,758,567)	
ニュー ジーラン ド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	107,000.00	124,120.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	135,705.00	272,767.05	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	200,506.00	182,460.46	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND	192,441.00	232,853.61	
	STRIDE PROPERTY GROUP	90,554.00	134,019.92	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	57,519.00	132,868.89	
	ニュージーランド・ドル小計	783,725.00	1,079,089.93 (92,942,016)	
イギリ ス・ボン ド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	53,280.00	28,877.76	
	AEW UK REIT PLC	9,000.00	8,685.00	
	ASSURA PLC	378,833.00	208,736.98	
	BALANCED COMM PROPERTY TRUST	89,651.00	81,582.41	
	BIG YELLOW GROUP PLC	23,140.00	254,077.20	
	BRITISH LAND CO PLC	135,414.00	548,020.45	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES	125,000.00	129,625.00	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	108,964.00	66,359.07	
	CUSTODIAN REIT PLC	39,999.00	36,759.08	
	DERWENT LONDON PLC	15,701.00	375,881.94	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	95,000.00	83,315.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	30,485.00	154,406.52	
	HAMMERSON PLC	440,241.00	109,179.76	
	HOME REIT PLC	96,051.00	53,596.45	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	41,816.00	43,154.11	
INTU PROPERTIES PLC	28,500.00	285.00		

	LAND SECURITIES GROUP PLC	108,634.00	674,182.60	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	141,905.00	257,273.76	
	LXI REIT PLC	247,814.00	288,455.49	
	NEWRIVER REIT PLC	46,021.00	35,298.10	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	57,141.00	49,198.40	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	182,000.00	206,570.00	
	PRS REIT PLC/THE	89,207.00	75,825.95	
	REGIONAL REIT LTD	45,664.00	27,398.40	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	31,848.00	289,657.56	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	70,698.00	31,672.70	
	SEGRO PLC	167,300.00	1,352,453.20	
	SHAFTESBURY PLC	36,339.00	132,346.63	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	187,422.00	201,478.65	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	34,770.00	23,782.68	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	259,000.00	378,917.00	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	117,847.00	70,236.81	
	UNITE GROUP PLC/THE	55,500.00	525,307.50	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	76,400.00	106,578.00	
	WAREHOUSE REIT PLC	72,100.00	81,905.60	
	WORKSPACE GROUP PLC	20,210.00	85,649.98	
	イギリス・ポンド小計	3,758,895.00	7,076,730.74 (1,176,364,951)	
イスラエル・シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	110,000.00	194,590.00	
	REIT 1 LTD	26,169.00	490,145.37	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	25,500.00	223,048.50	
	イスラエル・シュケル小計	161,669.00	907,783.87 (36,614,555)	
韓国・ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	6,350.00	21,717,000.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	24,000.00	96,000,000.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	4,067.00	18,484,515.00	
	JR REIT XXVII	19,000.00	81,700,000.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	6,226.00	30,818,700.00	
	LOTTE REIT CO LTD	20,121.00	79,075,530.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	9,815.00	40,535,950.00	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	12,561.00	39,441,540.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	8,762.00	60,107,320.00	
SK REITS CO LTD	12,831.00	58,958,445.00		
	韓国・ウォン小計	123,733.00	526,839,000.00 (55,212,727)	
ユーロ	AEDIFICA	5,710.00	433,103.50	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	850.00	6,205.00	
	ALTAREA	723.00	100,786.20	
	CARE PROPERTY INVEST	3,490.00	53,048.00	
	CARMILA	7,172.00	99,834.24	
	COFINIMMO	4,000.00	336,600.00	

COVIVIO	6,175.00	347,961.25	
CROMWELL REIT EUR	48,320.00	75,379.20	
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	5,801.00	135,859.42	
GECINA SA	7,550.00	715,362.50	
HAMBORNER REIT AG	9,937.00	74,030.65	
ICADE	3,844.00	155,605.12	
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	4,798.00	15,617.49	
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	42,359.00	253,095.02	
INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	4,899.00	102,389.10	
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	52,815.00	60,842.88	
KLEPIERRE	26,996.00	601,470.88	
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	6,940.00	30,813.60	
MERCIALYS	11,000.00	104,555.00	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	49,800.00	451,188.00	
MONTEA NV	1,880.00	122,012.00	
NSI NV	2,966.00	72,222.10	
RETAIL ESTATES	1,586.00	98,173.40	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	15,400.00	800,492.00	
VASTNED RETAIL NV	2,035.00	44,057.75	
WAREHOUSES DE PAUW SCA	18,467.00	474,971.24	
WERELDHAVE NV	5,522.00	74,933.54	
XIOR STUDENT HOUSING NV	2,441.00	69,568.50	
ユーロ小計	353,476.00	5,910,177.58 (848,583,297)	
投資証券合計		24,586,639,159 (24,586,639,159)	
合計		24,586,639,159 (24,586,639,159)	

(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	145銘柄	76.8%	77.7%
カナダ・ドル	投資証券	30銘柄	1.9%	1.9%
オーストラリア・ドル	投資証券	31銘柄	6.6%	6.7%
香港・ドル	投資証券	6銘柄	1.3%	1.3%
シンガポール・ドル	投資証券	25銘柄	3.3%	3.4%
ニュージーランド・ドル	投資証券	6銘柄	0.4%	0.4%
イギリス・ポンド	投資証券	36銘柄	4.7%	4.8%
イスラエル・シケル	投資証券	3銘柄	0.1%	0.1%
韓国・ウォン	投資証券	10銘柄	0.2%	0.2%
ユーロ	投資証券	28銘柄	3.4%	3.5%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

ゴールド・インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2021年11月30日現在)	(2022年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	63,327,388	44,944,694
金銭信託	553,062	4,242,207
コール・ローン	16,311,621	26,174,794
投資信託受益証券	876,932,357	3,754,431,327
派生商品評価勘定	2,425	1,728
流動資産合計	957,126,853	3,829,794,750
資産合計	957,126,853	3,829,794,750
負債の部		
流動負債		
未払金	95,212,463	53,523,970
未払解約金	15,187	1,069,582
その他未払費用	55	122
流動負債合計	95,227,705	54,593,674
負債合計	95,227,705	54,593,674
純資産の部		
元本等		
元本	864,264,346	3,178,413,029
剰余金		
剰余金又は欠損金()	2,365,198	596,788,047
元本等合計	861,899,148	3,775,201,076
純資産合計	861,899,148	3,775,201,076
負債純資産合計	957,126,853	3,829,794,750

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券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) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券</p> <p>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</p> <p>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>

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	(2021年11月30日現在)	(2022年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	864,264,346口	3,178,413,029口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 2,365,198円	元本の欠損
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9973円 (1万口当たりの純資産額9,973円)	1口当たり純資産額 1.1878円 (1万口当たりの純資産額11,878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12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券</p> <p>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引</p> <p>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p>

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	41,172,236	-	41,174,661	2,425
	小計	41,172,236	-	41,174,661	2,425
合 計		41,172,236	-	41,174,661	2,425

(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	39,987,446	-	39,989,174	1,728
	小計	39,987,446	-	39,989,174	1,728
合 計		39,987,446	-	39,989,174	1,728

(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12月1日 至 2022年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

（2021年11月30日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	2,862,026円
同期中における追加設定元本額	862,353,380円
同期中における一部解約元本額	951,060円
2021年11月30日現在の元本の内訳	
日興FWS・ゴールド（為替ヘッジあり）	138,779,891円
日興FWS・ゴールド（為替ヘッジなし）	688,097,982円
三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）	37,386,473円
合計	864,264,346円

（2022年11月30日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	864,264,346円
同期中における追加設定元本額	2,632,159,819円
同期中における一部解約元本額	318,011,136円
2022年11月30日現在の元本の内訳	
日興FWS・ゴールド（為替ヘッジあり）	316,496,322円
日興FWS・ゴールド（為替ヘッジなし）	2,580,676,358円
三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）	281,240,349円
合計	3,178,413,029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
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	iShares Gold Trust	249,190.00	8,270,616.10	
		SPDR Gold MiniShares Trust	540,310.00	18,764,966.30	
	アメリカ・ドル小計		789,500.00	27,035,582.40 (3,754,431,327)	
投資信託受益証券合計				3,754,431,327 (3,754,431,327)	
合計				3,754,431,327 (3,754,431,327)	

（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	合計金額に 対する比率
			投資信託受益証券 時価比率	
アメリカ・ドル	投資信託受益証券	2銘柄	99.4%	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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

2022年12月30日現在

資産総額	60,567,235円
負債総額	19,663円
純資産総額(-)	60,547,572円
発行済口数	58,602,366口
1口当たり純資産額(/) (1万口当たり純資産額)	1.0332円 (10,332円)

三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

2022年12月30日現在

資産総額	257,875,252円
負債総額	86,043円
純資産総額(-)	257,789,209円
発行済口数	260,448,119口
1口当たり純資産額(/) (1万口当たり純資産額)	0.9898円 (9,898円)

三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド

2022年12月30日現在

資産総額	324,766,743円
負債総額	40,222,982円
純資産総額(-)	284,543,761円
発行済口数	273,290,866口
1口当たり純資産額(/) (1万口当たり純資産額)	1.0412円 (10,412円)

三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド

2022年12月30日現在

資産総額	28,728,141円
負債総額	4,707,272円
純資産総額(-)	24,020,869円
発行済口数	25,108,116口
1口当たり純資産額(/) (1万口当たり純資産額)	0.9567円 (9,567円)

三井住友D S ・先進国債インデックス・ファンド

2022年12月30日現在

資産総額	83,563,080円
負債総額	3,660,575円
純資産総額（ - ）	79,902,505円
発行済口数	83,735,869口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	0.9542円 (9,542円)

三井住友D S ・新興国債インデックス・ファンド

2022年12月30日現在

資産総額	12,740,748円
負債総額	4,853円
純資産総額（ - ）	12,735,895円
発行済口数	14,505,957口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	0.8780円 (8,780円)

三井住友D S ・国内リートインデックス・ファンド

2022年12月30日現在

資産総額	129,542,536円
負債総額	38,928円
純資産総額（ - ）	129,503,608円
発行済口数	139,871,192口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	0.9259円 (9,259円)

三井住友D S ・先進国リートインデックス・ファンド

2022年12月30日現在

資産総額	72,965,243円
負債総額	30,011円
純資産総額（ - ）	72,935,232円
発行済口数	73,423,445口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	0.9934円 (9,934円)

三井住友D S ・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）

2022年12月30日現在

資産総額	371,155,763円
負債総額	163,508円

純資産総額（ - ）	370,992,255円
発行済口数	388,195,715口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	0.9557円 （9,557円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

イ 名義書換

該当事項はありません。

ロ 受益者名簿

作成しません。

ハ 受益者に対する特典

ありません。

ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等

（イ）受益権の譲渡

- a. 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。
- b. 上記aの申請のある場合には、上記aの振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記aの振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。
- c. 上記aの振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認め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12月30日現在
資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060株

ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

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。

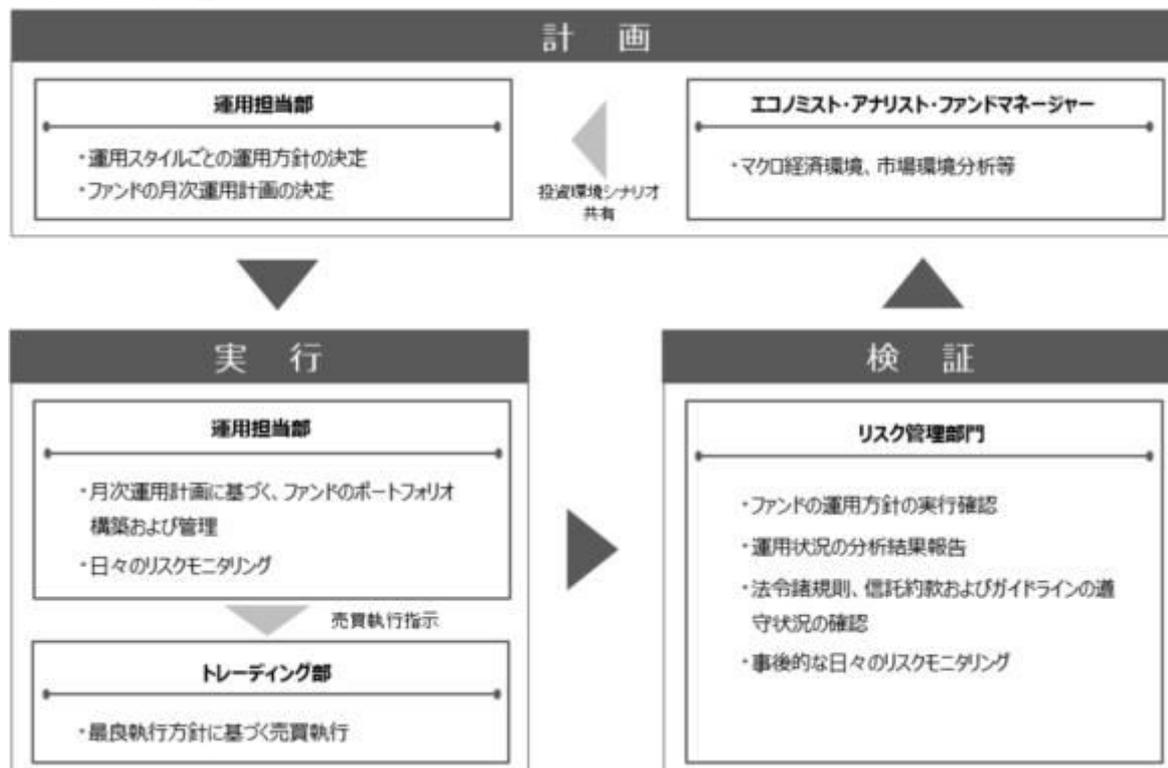
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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

	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	700	8,981,757
単位型株式投資信託	97	570,058
追加型公社債投資信託	1	24,802
単位型公社債投資信託	182	292,970
合計	980	9,869,589

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

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	21,185,470	113,741,454	377,855	377,855	114,119,309
当期変動額					
剰余金の配当	711,271	711,271			711,271
当期純損失（ ）	28,934,237	28,934,237			28,934,237
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）			571,510	571,510	571,510
当期変動額合計	29,645,508	29,645,508	571,510	571,510	29,073,997
当期末残高	8,460,037	84,095,946	949,365	949,365	85,045,311

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			利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	その他資本 剰余金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金		
					配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金	
当期首残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	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)
繰延税金資産		
退職給付引当金	1,610,136	1,556,876
賞与引当金	464,389	643,119
調査費	247,208	279,809
未払金	206,090	284,070
未払事業税	66,891	139,522
ソフトウェア償却	90,431	107,998
子会社株式評価損	114,876	114,876
その他有価証券評価差額金	131,391	93,946
その他	35,930	28,056
繰延税金資産小計	2,967,346	3,248,274
評価性引当額(注)	218,966	189,102
繰延税金資産合計	2,748,380	3,059,171
繰延税金負債		
無形固定資産	4,798,732	4,151,648
資産除去債務	-	825
その他有価証券評価差額金	516,605	186,107
繰延税金負債合計	5,315,338	4,338,581
繰延税金資産(負債)の純額	2,566,958	1,279,409

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

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

(収益認識関係)

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

(セグメント情報等)

前事業年度(自2020年4月1日至2021年3月31日)

1. セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業

活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への 営業収益	50,610,457	9,450,169	1,270,584	233,628	61,564,839

(2) 地域ごとの情報

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おりません。

当事業年度の潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

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

	前事業年度 (自 2020年 4月 1日 至 2021年 3月 31日)	当事業年度 (自 2021年 4月 1日 至 2022年 3月 31日)
1株当たり当期純利益又は当期純損失		
当期純利益又は当期純損失()(千円)	28,934,237	4,119,040
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益又は 当期純損失()(千円)	28,934,237	4,119,040
期中平均株式数(株)	33,870,060	33,870,060

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おりません。	

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- イ 定款の変更、その他の重要事項
 - (イ) 定款の変更
該当ありません。
 - (ロ) その他の重要事項
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
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。

2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

□ 販売会社

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

3【資本関係】

(持株比率5%以上を記載しています。)

該当事項はありません。

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

2023年2月7日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	菅野 雅子
--------------------	-------	-------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	松井 貴志
--------------------	-------	-------

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンドの2021年12月1日から2022年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンドの2022年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

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

2023年2月7日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	菅野 雅子
--------------------	-------	-------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	松井 貴志
--------------------	-------	-------

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・日経225インデックス・ファンドの2021年12月1日から2022年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・日経225インデックス・ファンドの2022年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

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

2023年2月7日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンドの2021年12月1日から2022年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンドの2022年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

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

2023年2月7日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	菅野 雅子
--------------------	-------	-------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	松井 貴志
--------------------	-------	-------

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンドの2021年12月1日から2022年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンドの2022年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

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

2023年2月7日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	菅野 雅子
--------------------	-------	-------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	松井 貴志
--------------------	-------	-------

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・先進国債インデックス・ファンドの2021年12月1日から2022年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・先進国債インデックス・ファンドの2022年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

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

2023年2月7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 石井 勝也指定有限責任社員
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、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・新興国債インデックス・ファンドの2021年12月1日から2022年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・新興国債インデックス・ファンドの2022年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

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

2023年2月7日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	菅野 雅子
--------------------	-------	-------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	松井 貴志
--------------------	-------	-------

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・国内リートインデックス・ファンドの2021年12月1日から2022年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・国内リートインデックス・ファンドの2022年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

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

2023年2月7日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンドの2021年12月1日から2022年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンドの2022年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

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

2023年2月7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	石井 勝也
--------------------	-------	-------

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、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）の2021年12月1日から2022年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）の2022年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

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。