

## 【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5月17日提出
【発行者名】	三井住友D S アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 猿田 隆
【本店の所在の場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【事務連絡者氏名】	土屋 裕子
【電話番号】	03-6205-1649
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	三井住友D S ・年金バランス30（債券重点型） 三井住友D S ・年金バランス50（標準型） 三井住友D S ・年金バランス70（株式重点型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	三井住友D S ・年金バランス30（債券重点型） 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S ・年金バランス50（標準型） 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S ・年金バランス70（株式重点型） 2兆5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

三井住友D S・年金バランス30（債券重点型）

三井住友D S・年金バランス50（標準型）

三井住友D S・年金バランス70（株式重点型）

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

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

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

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンド2兆5,000億円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

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

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

(5) 【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

(7) 【申込期間】

2023年5月18日から2023年11月16日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。

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

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

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

## ( 1 2 ) 【その他】

イ 申込証拠金  
ありません。

ロ 日本以外の地域における募集  
ありません。

ハ クーリング・オフ制度（金融商品取引法第37条の6）の適用  
ありません。

## ニ 振替受益権について

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

## （参考：投資信託振替制度）

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

- イ 当ファンドは、「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債に分散投資します。
- ロ 各ファンドの運用にあたっては、株式、債券、短期金融資産を各ファンド毎の基本資産配分の比率により独自に作成した合成指数をベンチマークとして、当該指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- ベンチマークの詳細については、後述の「2 投資方針」をご参照ください。
- ハ 委託会社は、受託会社と合意の上、各ファンドにつき、金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。
- ニ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

##### （イ）当ファンドが該当する商品分類

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

##### （ロ）当ファンドが該当する属性区分

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

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

## (2) 【ファンドの沿革】

2019年6月28日 信託契約締結、設定、運用開始。

## (3) 【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(イ) 委託会社 「三井住友D Sアセットマネジメント株式会社」

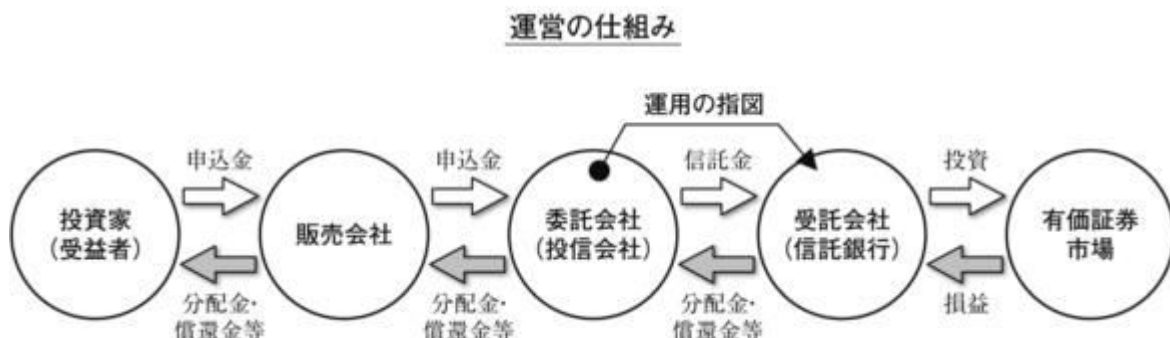
証券投資信託契約に基づき、信託財産の運用指図、投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の作成等を行います。

(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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

(ハ) 販売会社

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



ロ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

20億円（2023年3月31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

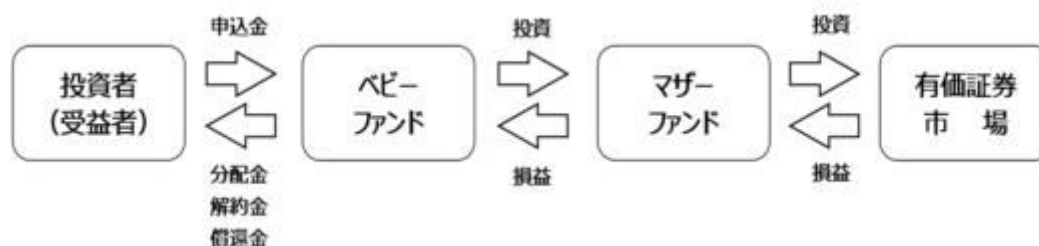
## (八) 大株主の状況

(2023年3月31日現在)

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

## 八 ファンドの運用形態（ファミリーファンド方式による運用）

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



## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

## イ 基本方針

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

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



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

ロ 投資態度

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

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

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

(ロ) 各ファンドの運用は、以下の比率により委託会社が独自に作成した合成指数をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。

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

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

(二) 非株式割合に関する制限

a . マイパッケージN E X T 30

制限はありません。

b . マイパッケージN E X T 50

株式以外の資産(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。)への投資割合は、原則として信託財産総額の75%以下とします。

c . マイパッケージN E X T 70

株式以外の資産(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。)への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

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

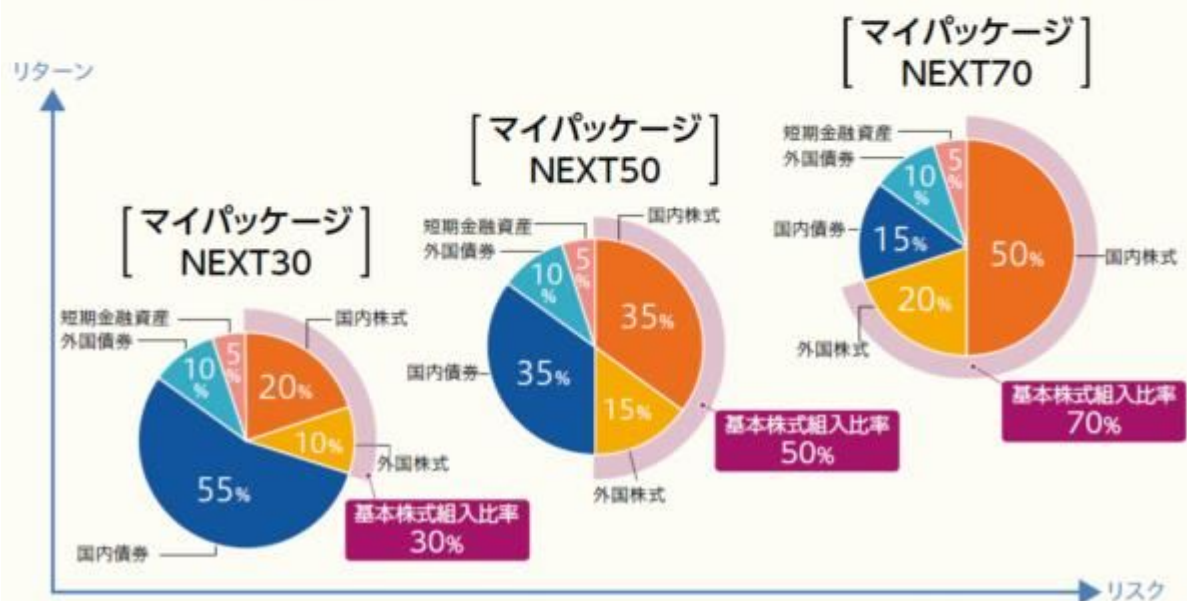
## ファンドの特色

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

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

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

### 〔基本資産配分とリスク・リターンのイメージ〕



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

### 3 委託会社が独自に作成した合成指数の動きに連動する投資成果を目指します。

#### 〔各ファンドのベンチマークの資産別合成比率〕

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



#### 指数の著作権など

- TOPIX(東証株価指数)は株式会社JPX総研、NOMURA-BPIは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、MSCIコクサイ・インデックスはMSCI Inc.、FTSE世界国債インデックスはFTSE Fixed Income LLCが、それぞれ公表している指数です。
- 各インデックスに関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は、指数を公表および許諾する各社に帰属します。また、当該各社は当ファンドの取引および運用成果等に関して一切責任を負いません。

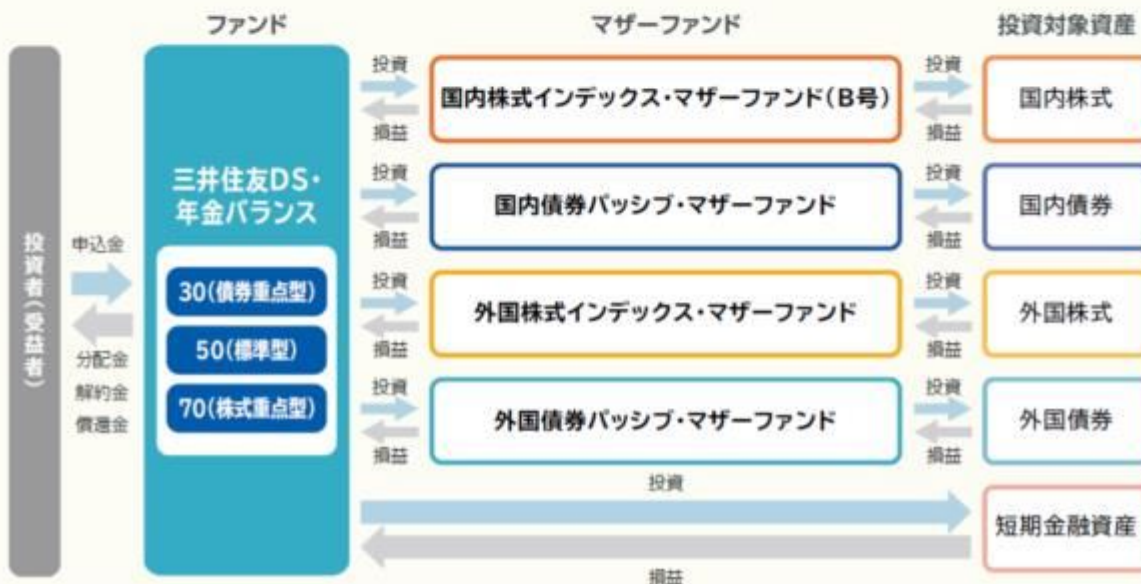
### 4 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジは行いません。

- 基準価額は為替変動の影響を受けます。

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

#### ファンドのしくみ

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





## 各マザーファンドの投資方針等

### ▶ 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

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

### ▶ 国内債券パッシブ・マザーファンド

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

### ▶ 外国株式インデックス・マザーファンド

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

### ▶ 外国債券パッシブ・マザーファンド

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



#### 最適化法とは

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

#### 層化抽出法とは

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

#### デュレーションとは

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

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

## (2) 【投資対象】

### イ 投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

1. 有価証券
2. デリバティブ取引にかかる権利

3. 約束手形

4. 金銭債権

(口) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1. 為替手形

口 投資対象とする有価証券

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

1. 株券または新株引受権証書
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
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
14. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
15. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。次号において同じ。）で次号に定めるもの以外のもの
16. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下本号において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
17. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限りません。）
19. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
21. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
22. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの
23. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

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

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

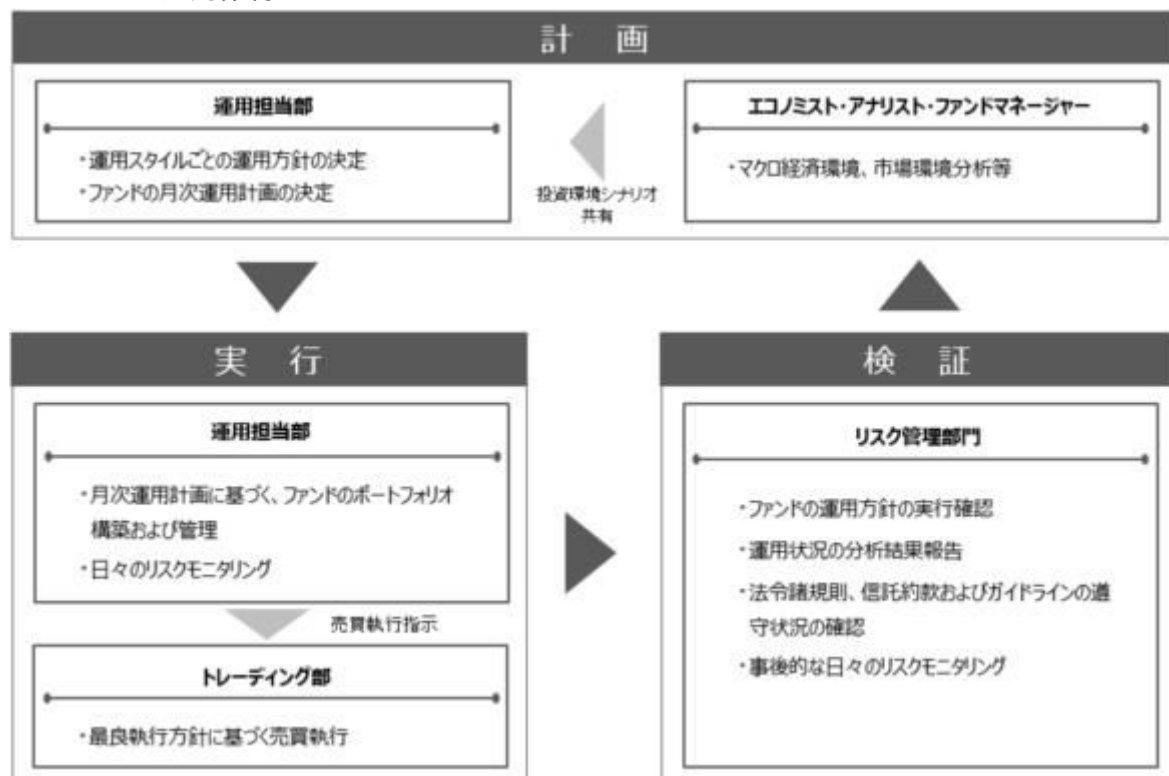
#### 八 投資対象とする金融商品

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

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

### （3）【運用体制】

#### イ ファンドの運用体制



リスク管理部門の人員数は、約50名です。

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

#### ロ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

### （4）【分配方針】

年1回（原則として毎年2月18日。ただし、休業日の場合は翌営業日となります。）決算を行い、

原則として以下の方針に基づき分配金額を決定します。

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

ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。

（基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。）

#### （５）【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- イ 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額に対して、以下の通りとします。

マイパッケージNEXT30	50%未満
マイパッケージNEXT50	25%以上
マイパッケージNEXT70	50%以上

実質投資割合とは、当ファンドが保有するある種類の資産の評価額が当ファンドの純資産総額に占める比率（「組入比率」といいます。）と、当該同一種類の資産のマザーファンドにおける組入比率に当該マザーファンド受益証券の当ファンドにおける組入比率を乗じて得た率を合計したものをいいます（以下同じ。）。
  - ロ 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。
  - ハ 投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
  - ニ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

#### イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的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、株券の引渡または買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- （ロ）上記（イ）の信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託

財産に属する当該売付けにかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

## ホ スワップ取引の指図

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

## ヘ 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図

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



行うことの指図をすることができます。

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

#### ト 有価証券の貸付けの指図

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

の各号の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。

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

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

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

#### チ 有価証券の空売りの指図

(イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡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) 借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

#### ヌ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

#### ル 外国為替予約取引の指図

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

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

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

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

#### ロ 資金の借入れ

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

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

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

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

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

(ニ)借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

#### 法令に基づく投資制限

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

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

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

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

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

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

(参考情報:マザーファンドの投資方針等)

(国内株式インデックス・マザーファンド(B号))

(1)投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

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

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

## (2) 投資対象

### イ 投資対象とする資産の種類

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

### ロ 投資対象とする有価証券

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

### ハ 投資対象とする金融商品

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

## (3) 投資制限

### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 外貨建資産への投資は行いません。

(ロ) 株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

## (国内債券パッシブ・マザーファンド)

### (1) 投資方針等

#### イ 基本方針

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

#### ロ 投資態度

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

(ロ) 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

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

## (2) 投資対象

### イ 投資対象とする資産の種類

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

### ロ 投資対象とする有価証券

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

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

### ハ 投資対象とする金融商品

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

## (3) 投資制限

## イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

## ( 外国株式インデックス・マザーファンド )

## ( 1 ) 投資方針等

## イ 基本方針

主として日本を除く世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）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) 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行わないものとします。
- (ハ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

## ( 2 ) 投資対象

## イ 投資対象とする資産の種類

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

## ロ 投資対象とする有価証券

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

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 特別の法律により法人の発行する債券
4. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
5. コマーシャル・ペーパー
6. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
7. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
8. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
9. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

す。)

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

#### 八 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針（2）投資対象 八 投資対象とする金融商品」において記載したベビーフンドが投資対象とする金融商品に同じです。

#### （3）投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）株式への投資割合には制限を設けません。

（ロ）外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

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

#### （外国債券パッシブ・マザーファンド）

##### （1）投資方針等

イ 基本方針

F T S E世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）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）ポートフォリオ構築にあたっては、取引コストを極力抑えながら、推定トラッキングエラーを最小化します。

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

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

（ホ）公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

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

## （２）投資対象

### イ 投資対象とする資産の種類

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

### ロ 投資対象とする有価証券

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

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

### ハ 投資対象とする金融商品

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

## （３）投資制限

### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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



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

### 3【投資リスク】

#### イ ファンドのもつリスクの特性

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

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

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

当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

#### (イ) 株式市場リスク

内外の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、株価が下落した場合は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ます。また、格付けが引き下げられる場合も債券価格が下落するおそれがあります。債券価格の下落はファンドの基準価額が下落する要因となります。なお、価格の変動幅は、債券の種類、格付け、残存期間、利払いのしくみの違い等により、債券ごとに異なります。

#### (ハ) 信用リスク

ファンドが投資している有価証券や金融商品において債務不履行が発生あるいは懸念される場合、またはその発行体が経営不安や倒産等に陥った場合には、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。

#### (ニ) 為替変動リスク

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

#### (ホ) 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等の価格が大きく変動することがあり、基準価額が下落する要因となります。

### （ヘ）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、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。

### ロ その他の留意点

#### （イ）ファンド固有の留意点

合成指数の動きと連動しない要因

ファンドは、委託会社が独自に作成した合成指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。以下の要因等により、合成指数の動きに連動しないことがあります。

- ・ 有価証券売買時のコスト、信託報酬やその他のファンド運営にかかる費用を負担すること
- ・ 追加設定・一部解約により組入有価証券の売買のタイミング差が生じること
- ・ インデックス構成銘柄と組入有価証券との誤差が影響すること
- ・ 利用可能な指数先物とインデックスの動きに不一致が生じること

#### （ロ）投資信託に関する留意点

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

これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性、換金申込みの受付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。

#### （ハ）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。

### 八 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。

#### ■マイパッケージNEXT30



### 「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。



#### ■マイパッケージNEXT50



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

※ファンドのベンチマークは合成指数です。

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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。



### 「ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移」

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

#### ■マイパッケージNEXT70



※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。  
※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。  
※ファンドのベンチマークは合成指数です。

### 「ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較」

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



※ファンドの騰落率は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。  
※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## 各資産クラスの指数

日本株	TOPIX(東証株価指数、配当込み) 株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社が算出、公表する指数で、日本の株式を対象としています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、日本を除く世界の主要先進国の株式を対象としています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、新興国の株式を対象としています。
日本国債	NOMURA-BPI(国債) 野村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	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド(円ベース) J.P. Morganが算出、公表する指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。  
※上記各指数に関する知的所有権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。また、上記各指数の発行者および許諾者は、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

ありません。

## (2) 【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

## (3) 【信託報酬等】

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

信託報酬の配分は以下の通りです。

< 信託報酬の配分（税抜き） >

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

上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。

## (4) 【その他の手数料等】

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

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

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

## (5) 【課税上の取扱い】

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

ります。

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

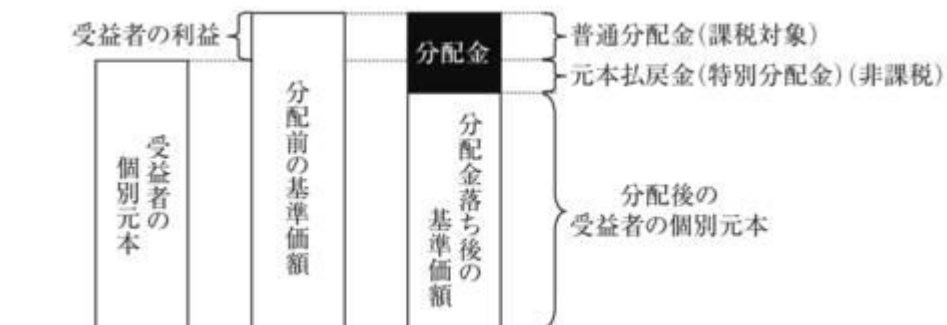
#### ハ 収益分配金の課税について

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。

< 配当控除および益金不算入制度の適用の可否 >

a . マイパッケージNEXT30

配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

b . マイパッケージNEXT50

配当控除の適用が可能です。益金不算入制度の適用はありません。

c . マイパッケージNEXT70

配当控除の適用が可能です。益金不算入制度の適用はありません。

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

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

課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家に確認されることをお勧めいたします。

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

※NISA、ジュニアNISAをご利用になる場合、各制度の違いにご留意ください。  
また、販売会社での専用口座の開設等、一定の要件があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

	少額投資非課税制度 NISA	未成年者少額投資非課税制度 ジュニアNISA
対象となる投資信託	公募株式投資信託	
非課税対象	公募株式投資信託から生じる配当所得および譲渡所得	
利用対象となる方	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、2023年3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・年金バランス30(債券重点型)

2023年3月31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	693,277,118	95.24
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	34,638,384	4.76
合計(純資産総額)		727,915,502	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・年金バランス50(標準型)

2023年3月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	2,157,473,998	95.06
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	112,017,143	4.94
合計(純資産総額)		2,269,491,141	100.00

#### 三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)

2023年3月31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	1,452,591,797	95.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	74,881,635	4.90
合計(純資産総額)		1,527,473,432	100.00

### (2)【投資資産】

#### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### 三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)

##### イ 主要投資銘柄

2023年3月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
------	----	-----	----	-------------	-------------	------------------	------------	-----------------

日本	親投資 信託受 益証券	国内債券パッシ ブ・マザーファ ンド	319,067,095	1.2144	387,460,628	1.2401	395,675,104	54.36
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）	42,600,704	3.4341	146,295,624	3.4858	148,497,534	20.40
日本	親投資 信託受 益証券	外国株式イン デックス・マ ザーファンド	12,262,423	6.2012	76,042,213	6.1473	75,380,792	10.36
日本	親投資 信託受 益証券	外国債券パッシ ブ・マザーファ ンド	37,417,494	1.9397	72,578,672	1.9703	73,723,688	10.13

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

2023年3月31日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	95.24
合計	95.24

#### 三井住友D S・年金バランス50（標準型）

#### イ 主要投資銘柄

2023年3月31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）	230,309,810	3.4360	791,334,267	3.4858	802,813,935	35.37
日本	親投資 信託受 益証券	国内債券パッシ ブ・マザーファ ンド	628,228,262	1.2143	762,855,668	1.2401	779,065,867	34.33
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	56,688,563	6.2036	351,675,310	6.1473	348,481,603	15.36
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	115,268,027	1.9397	223,587,210	1.9703	227,112,593	10.01

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

#### ロ 種類別投資比率

2023年3月31日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	95.06
合計	95.06

## 三井住友D S ・年金バランス70（株式重点型）

## イ 主要投資銘柄

2023年3月31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)	219,991,444	3.4368	756,074,909	3.4858	766,846,175	50.20
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	50,548,825	6.2127	314,042,842	6.1473	310,738,791	20.34
日本	親投資 信託受 益証券	国内債券パッシ ブ・マザーファ ンド	179,948,775	1.2144	218,532,133	1.2401	223,154,475	14.61
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	77,070,678	1.9400	149,514,900	1.9703	151,852,356	9.94

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

2023年3月31日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	95.10
合計	95.10

## 【投資不動産物件】

## 三井住友D S ・年金バランス30（債券重点型）

該当事項はありません。

## 三井住友D S ・年金バランス50（標準型）

該当事項はありません。

## 三井住友D S ・年金バランス70（株式重点型）

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

## 三井住友D S ・年金バランス30（債券重点型）

該当事項はありません。

## 三井住友DS・年金バランス50(標準型)

該当事項はありません。

## 三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)

該当事項はありません。

## (3)【運用実績】

## 【純資産の推移】

## 三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2020年 2月18日)	1,036,533	1,036,533	10,365	10,365
第2期 (2021年 2月18日)	129,349,680	129,349,680	10,869	10,869
第3期 (2022年 2月18日)	244,216,550	244,216,550	11,031	11,031
第4期 (2023年 2月20日)	695,911,173	695,911,173	11,084	11,084
2022年 3月末日	280,994,460	-	11,247	-
4月末日	288,055,096	-	11,130	-
5月末日	515,078,160	-	11,125	-
6月末日	639,959,447	-	11,026	-
7月末日	634,370,155	-	11,197	-
8月末日	650,021,062	-	11,204	-
9月末日	638,235,493	-	10,949	-
10月末日	662,644,066	-	11,187	-
11月末日	668,144,046	-	11,154	-
12月末日	665,441,369	-	10,847	-
2023年 1月末日	686,307,459	-	10,979	-
2月末日	698,591,460	-	11,119	-
3月末日	727,915,502	-	11,257	-

## 三井住友DS・年金バランス50(標準型)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2020年 2月18日)	2,279,719	2,279,719	10,571	10,571
第2期 (2021年 2月18日)	335,342,429	335,342,429	11,511	11,511
第3期 (2022年 2月18日)	718,044,759	718,044,759	11,845	11,845
第4期 (2023年 2月20日)	2,144,057,572	2,144,057,572	12,173	12,173

2022年 3月末日	841,507,528	-	12,173	-
4月末日	829,867,948	-	11,985	-
5月末日	1,449,408,828	-	11,995	-
6月末日	1,671,536,709	-	11,860	-
7月末日	1,738,080,328	-	12,119	-
8月末日	1,797,618,018	-	12,158	-
9月末日	1,777,021,061	-	11,777	-
10月末日	1,898,633,646	-	12,181	-
11月末日	1,970,357,090	-	12,193	-
12月末日	1,975,370,260	-	11,768	-
2023年 1月末日	2,063,485,083	-	12,019	-
2月末日	2,149,422,115	-	12,183	-
3月末日	2,269,491,141	-	12,325	-

## 三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2020年 2月18日)	1,078,471	1,078,471	10,785	10,785
第2期 (2021年 2月18日)	212,907,677	212,907,677	12,154	12,154
第3期 (2022年 2月18日)	476,770,596	476,770,596	12,669	12,669
第4期 (2023年 2月20日)	1,467,519,245	1,467,519,245	13,306	13,306
2022年 3月末日	606,093,228	-	13,120	-
4月末日	608,226,834	-	12,850	-
5月末日	955,649,755	-	12,879	-
6月末日	1,098,699,033	-	12,703	-
7月末日	1,152,369,309	-	13,060	-
8月末日	1,196,509,250	-	13,136	-
9月末日	1,176,564,177	-	12,612	-
10月末日	1,274,176,183	-	13,204	-
11月末日	1,302,534,652	-	13,268	-
12月末日	1,299,674,789	-	12,710	-
2023年 1月末日	1,406,641,741	-	13,095	-
2月末日	1,469,056,981	-	13,285	-
3月末日	1,527,473,432	-	13,433	-

## 【分配の推移】

## 三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)

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

第4期	2022年 2月19日～2023年 2月20日	0
-----	-------------------------	---

## 三井住友D S・年金バランス50(標準型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2019年 6月28日～2020年 2月18日	0
第2期	2020年 2月19日～2021年 2月18日	0
第3期	2021年 2月19日～2022年 2月18日	0
第4期	2022年 2月19日～2023年 2月20日	0

## 三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2019年 6月28日～2020年 2月18日	0
第2期	2020年 2月19日～2021年 2月18日	0
第3期	2021年 2月19日～2022年 2月18日	0
第4期	2022年 2月19日～2023年 2月20日	0

## 【収益率の推移】

## 三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)

	収益率(%)
第1期	3.7
第2期	4.9
第3期	1.5
第4期	0.5

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

## 三井住友D S・年金バランス50(標準型)

	収益率(%)
第1期	5.7
第2期	8.9
第3期	2.9
第4期	2.8

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

## 三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)

	収益率(%)
第1期	7.9

第2期	12.7
第3期	4.2
第4期	5.0

(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。

#### (4) 【設定及び解約の実績】

##### 三井住友D S・年金バランス30（債券重点型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	1,000,000	0
第2期	129,718,508	11,715,048
第3期	128,773,003	26,390,611
第4期	462,903,268	56,454,623

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

##### 三井住友D S・年金バランス50（標準型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2,156,528	0
第2期	322,790,706	33,614,202
第3期	361,775,633	46,907,692
第4期	1,237,975,860	82,847,945

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

##### 三井住友D S・年金バランス70（株式重点型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	1,000,000	0
第2期	190,606,278	16,430,623
第3期	241,009,796	39,861,352
第4期	790,507,406	63,891,265

(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）

2023年3月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	226,486,205,080	97.61
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	5,538,705,251	2.39
合計（純資産総額）		232,024,910,331	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	5,509,625,000	2.37
合計	買建	-	5,509,625,000	2.37

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

2023年3月31日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	95,424,745,860	78.61
地方債証券	日本	9,416,074,500	7.76
特殊債券	日本	9,058,265,310	7.46
社債券	日本	6,384,912,600	5.26
	フランス	200,001,400	0.16
	小計	6,584,914,000	5.42
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	908,199,580	0.75
合計（純資産総額）		121,392,199,250	100.00

## 外国株式インデックス・マザーファンド

2023年3月31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	310,013,211,565	66.38
	イギリス	19,972,845,346	4.28
	カナダ	16,573,229,793	3.55
	フランス	16,131,902,673	3.45
	スイス	15,294,500,917	3.27
	ドイツ	12,083,386,386	2.59
	オーストラリア	9,433,767,446	2.02
	オランダ	9,317,144,909	2.00
	アイルランド	8,338,282,933	1.79
	スウェーデン	4,394,424,167	0.94
	デンマーク	4,332,547,691	0.93
	スペイン	3,745,257,098	0.80
	香港	2,872,269,985	0.62
	イタリア	2,575,366,669	0.55
	ジャージー	1,717,597,560	0.37
	フィンランド	1,717,396,893	0.37
	シンガポール	1,625,358,856	0.35
	ベルギー	1,207,494,537	0.26
	ケイマン諸島	950,827,966	0.20
	イスラエル	940,538,576	0.20
ノルウェー	926,657,172	0.20	
バミューダ	681,297,040	0.15	
オランダ領キュラソー	644,876,677	0.14	



	ニュージーランド	383,893,926	0.08
	ルクセンブルグ	308,538,153	0.07
	オーストリア	258,327,853	0.06
	ポルトガル	255,348,428	0.05
	リベリア	139,111,265	0.03
	パナマ	94,620,586	0.02
	マン島	87,245,981	0.02
	小計	447,017,269,047	95.72
投資証券	アメリカ	8,509,031,728	1.82
	オーストラリア	903,022,562	0.19
	香港	211,198,881	0.05
	シンガポール	197,313,608	0.04
	イギリス	192,620,536	0.04
	フランス	167,356,383	0.04
	カナダ	53,077,165	0.01
	ベルギー	39,269,400	0.01
	小計	10,272,890,263	2.20
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	9,730,637,677	2.08
合計（純資産総額）		467,020,796,987	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	454,402,598	0.10
株価指数先物取引	買建	ドイツ	1,572,551,952	0.34
株価指数先物取引	買建	アメリカ	7,436,552,760	1.59
株価指数先物取引	買建	オーストラリア	352,212,630	0.08
合計	買建	-	9,815,719,940	2.10

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	-	2,156,069,519	0.46

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

2023年3月31日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	75,180,456,556	48.90
	フランス	12,890,262,893	8.38
	イタリア	11,672,729,233	7.59
	ドイツ	9,971,586,084	6.49
	スペイン	7,712,395,517	5.02
	イギリス	7,364,801,089	4.79
	中国	7,033,661,905	4.57
	カナダ	3,106,119,284	2.02
	ベルギー	2,872,869,071	1.87
	オーストラリア	2,407,346,419	1.57

	オランダ	2,345,574,402	1.53
	オーストリア	1,827,671,242	1.19
	メキシコ	1,309,539,922	0.85
	アイルランド	966,778,611	0.63
	マレーシア	835,526,764	0.54
	フィンランド	770,176,538	0.50
	ポーランド	699,415,963	0.45
	シンガポール	685,776,719	0.45
	デンマーク	501,542,889	0.33
	イスラエル	495,616,970	0.32
	ニュージーランド	336,064,258	0.22
	ノルウェー	315,827,829	0.21
	スウェーデン	311,879,817	0.20
	小計	151,613,619,975	98.61
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	2,141,779,981	1.39
合計（純資産総額）		153,755,399,956	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）

2023年3月31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	4,322,700	2,003.94	8,662,426,621	1,880.00	8,126,676,000	3.50
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	556,900	11,229.38	6,253,640,431	11,985.00	6,674,446,500	2.88
日本	株式	キーエンス	電気機器	78,800	56,990.98	4,490,889,460	64,450.00	5,078,660,000	2.19
日本	株式	三菱UFJ フィナンシャル・グループ	銀行業	4,854,300	758.24	3,680,714,582	847.90	4,115,960,970	1.77
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,011,800	3,819.11	3,864,178,941	3,962.00	4,008,751,600	1.73
日本	株式	第一三共	医薬品	687,900	4,505.87	3,099,590,775	4,822.00	3,317,053,800	1.43
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	698,600	4,052.33	2,830,959,043	4,350.00	3,038,910,000	1.31
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	566,200	4,700.62	2,661,490,658	5,298.00	2,999,727,600	1.29
日本	株式	日立製作所	電気機器	386,600	7,280.42	2,814,609,440	7,252.00	2,803,623,200	1.21
日本	株式	信越化学工業	化学	655,000	3,512.39	2,300,612,877	4,275.00	2,800,125,000	1.21
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	166,500	14,974.95	2,493,329,721	16,040.00	2,670,660,000	1.15
日本	株式	任天堂	その他製品	497,100	5,882.36	2,924,119,453	5,131.00	2,550,620,100	1.10
日本	株式	三井物産	卸売業	609,400	3,977.64	2,423,973,691	4,116.00	2,508,290,400	1.08

日本	株式	KDDI	情報・通信業	610,300	4,106.82	2,506,393,321	4,093.00	2,497,957,900	1.08
日本	株式	三菱商事	卸売業	520,800	4,592.51	2,391,776,691	4,751.00	2,474,320,800	1.07
日本	株式	HOYA	精密機器	168,100	14,038.20	2,359,820,586	14,560.00	2,447,536,000	1.05
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	456,600	5,945.72	2,714,813,959	5,182.00	2,366,101,200	1.02
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	639,800	3,346.28	2,140,950,117	3,510.00	2,245,698,000	0.97
日本	株式	ダイキン工業	機械	94,900	22,344.18	2,120,462,277	23,655.00	2,244,859,500	0.97
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	513,000	4,280.55	2,195,920,916	4,301.00	2,206,413,000	0.95
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	599,100	4,325.53	2,591,426,214	3,650.00	2,186,715,000	0.94
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,120,400	1,724.42	1,932,035,963	1,878.00	2,104,111,200	0.91
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	780,400	2,825.95	2,205,367,779	2,547.00	1,987,678,800	0.86
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	428,500	3,942.49	1,689,358,932	4,528.00	1,940,248,000	0.84
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,268,700	1,497.46	1,899,831,452	1,529.00	1,939,842,300	0.84
日本	株式	村田製作所	電気機器	238,600	7,440.60	1,775,327,267	8,040.00	1,918,344,000	0.83
日本	株式	ファナック	電気機器	386,500	4,074.74	1,574,888,550	4,760.00	1,839,740,000	0.79
日本	株式	S M C	機械	25,800	61,622.85	1,589,869,560	69,830.00	1,801,614,000	0.78
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	287,200	5,584.59	1,603,894,703	5,975.00	1,716,020,000	0.74
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	510,200	2,809.45	1,433,381,642	2,798.00	1,427,539,600	0.62

□ 種別・業種別投資比率

2023年3月31日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式(国内)	水産・農林業	0.09
	鉱業	0.29
	建設業	1.92
	食料品	3.45
	繊維製品	0.47
	パルプ・紙	0.17
	化学	6.15
	医薬品	5.42
	石油・石炭製品	0.45
	ゴム製品	0.76
	ガラス・土石製品	0.71
	鉄鋼	0.91
	非鉄金属	0.72
	金属製品	0.56
	機械	5.28
電気機器	17.66	

輸送用機器	7.28
精密機器	2.52
その他製品	2.20
電気・ガス業	1.18
陸運業	2.89
海運業	0.59
空運業	0.48
倉庫・運輸関連業	0.14
情報・通信業	8.46
卸売業	6.02
小売業	4.43
銀行業	5.78
証券、商品先物取引業	0.72
保険業	2.09
その他金融業	1.07
不動産業	1.80
サービス業	4.95
合計	97.61

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2023年3月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債 証券	4 4 4 2年国債	3,050,000,000	99.94	3,048,170,000	100.18	3,055,581,500	0.005	2025/01/01	2.52
日本	国債 証券	3 6 3 10年国 債	1,610,000,000	98.77	1,590,263,900	98.20	1,581,003,900	0.100	2031/06/20	1.30
日本	国債 証券	1 4 7 5年国債	1,310,000,000	100.17	1,312,227,000	100.18	1,312,318,700	0.005	2026/03/20	1.08
日本	国債 証券	1 5 6 5年国債	1,270,000,000	99.94	1,269,238,000	100.54	1,276,858,000	0.200	2027/12/20	1.05
日本	国債 証券	1 4 9 5年国債	1,240,000,000	100.15	1,241,872,400	100.10	1,241,289,600	0.005	2026/09/20	1.02
日本	国債 証券	1 5 0 5年国債	1,230,000,000	100.13	1,231,642,400	100.02	1,230,221,400	0.005	2026/12/20	1.01
日本	国債 証券	1 4 5 5年国債	1,180,000,000	100.49	1,185,778,800	100.43	1,185,097,600	0.100	2025/09/20	0.98
日本	国債 証券	1 5 3 5年国債	1,140,000,000	99.19	1,130,740,500	99.85	1,138,312,800	0.005	2027/06/20	0.94
日本	国債 証券	1 4 8 5年国債	1,130,000,000	100.15	1,131,695,000	100.16	1,131,808,000	0.005	2026/06/20	0.93
日本	国債 証券	3 6 2 10年国 債	1,150,000,000	99.22	1,140,979,000	98.41	1,131,669,000	0.100	2031/03/20	0.93
日本	国債 証券	3 6 9 10年国 債	1,110,000,000	100.00	1,110,022,200	101.70	1,128,814,500	0.500	2032/12/20	0.93

日本	国債 証券	1 5 4 5年国債	1,020,000,000	99.87	1,018,674,000	100.18	1,021,815,600	0.100	2027/09/20	0.84
日本	国債 証券	1 4 6 5年国債	1,000,000,000	100.52	1,005,167,200	100.45	1,004,480,000	0.100	2025/12/20	0.83
日本	国債 証券	3 5 9 10年国債	1,000,000,000	99.51	995,133,000	99.08	990,770,000	0.100	2030/06/20	0.82
日本	国債 証券	1 4 4 5年国債	980,000,000	100.48	984,664,800	100.40	983,910,200	0.100	2025/06/20	0.81
日本	国債 証券	3 6 1 10年国債	980,000,000	98.50	965,311,400	98.64	966,672,000	0.100	2030/12/20	0.80
日本	国債 証券	3 5 8 10年国債	940,000,000	99.68	936,965,600	99.25	932,903,000	0.100	2030/03/20	0.77
日本	国債 証券	3 6 0 10年国債	910,000,000	99.55	905,915,600	98.90	899,990,000	0.100	2030/09/20	0.74
日本	国債 証券	1 5 1 20年国債	840,000,000	107.51	903,109,100	107.04	899,102,400	1.200	2034/12/20	0.74
日本	国債 証券	3 6 5 10年国債	890,000,000	99.06	881,634,000	98.05	872,653,900	0.100	2031/12/20	0.72
日本	国債 証券	3 5 6 10年国債	850,000,000	98.57	837,870,400	99.49	845,648,000	0.100	2029/09/20	0.70
日本	国債 証券	3 6 7 10年国債	840,000,000	99.87	838,908,000	99.59	836,589,600	0.200	2032/06/20	0.69
日本	国債 証券	3 4 4 10年国債	811,000,000	100.56	815,557,820	100.43	814,511,630	0.100	2026/09/20	0.67
日本	国債 証券	3 3 8 10年国債	805,000,000	101.30	815,440,850	100.96	812,744,100	0.400	2025/03/20	0.67
日本	国債 証券	8 8 2 0年国債	742,000,000	109.51	812,586,460	107.56	798,124,880	2.300	2026/06/20	0.66
日本	国債 証券	3 3 9 10年国債	785,000,000	101.40	795,974,300	101.06	793,352,400	0.400	2025/06/20	0.65
日本	国債 証券	3 4 0 10年国債	770,000,000	101.50	781,519,200	101.17	779,032,100	0.400	2025/09/20	0.64
日本	国債 証券	1 4 3 5年国債	770,000,000	100.45	773,472,700	100.37	772,872,100	0.100	2025/03/20	0.64
日本	国債 証券	3 6 4 10年国債	760,000,000	97.92	744,181,300	98.11	745,598,000	0.100	2031/09/20	0.61
日本	国債 証券	3 5 4 10年国債	695,000,000	100.06	695,417,000	99.73	693,151,300	0.100	2029/03/20	0.57

## □ 種類別投資比率

2023年3月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	78.61
地方債証券	7.76
特殊債券	7.46
社債券	5.42
合計	99.25

## 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）

2023年3月31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	1,100,007	18,926.47	20,819,250,599	21,679.93	23,848,075,639	5.11
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	489,744	32,285.68	15,811,716,590	37,929.20	18,575,596,410	3.98
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	634,483	12,463.11	7,907,628,600	13,620.06	8,641,696,528	1.85
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	169,563	21,206.21	3,595,789,269	36,564.52	6,199,989,687	1.33
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	412,760	12,792.49	5,280,229,105	13,471.84	5,560,637,380	1.19
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	377,716	12,822.18	4,843,144,415	13,529.26	5,110,217,819	1.09
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	185,930	24,340.20	4,525,572,994	26,075.74	4,848,262,040	1.04
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	155,983	15,034.64	2,345,148,972	27,752.88	4,328,976,732	0.93
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	284,707	14,766.04	4,203,993,575	14,620.20	4,162,473,195	0.89

アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	64,776	70,216.45	4,548,340,706	62,767.11	4,065,802,433	0.87
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	181,319	23,431.51	4,248,577,060	20,487.51	3,714,774,444	0.80
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	90,305	42,064.78	3,798,659,762	40,737.33	3,678,784,802	0.79
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	203,194	18,267.13	3,711,771,976	17,191.99	3,493,308,708	0.75
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	112,974	28,059.28	3,169,968,549	29,691.73	3,354,393,595	0.72
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	164,482	19,413.93	3,193,242,561	19,689.00	3,238,485,851	0.69
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	190,037	16,248.21	3,087,761,869	16,185.76	3,075,892,969	0.66
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	59,607	46,045.24	2,744,618,820	47,971.99	2,859,466,276	0.61
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	127,235	24,122.93	3,069,281,610	21,683.94	2,758,955,686	0.59
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	70,430	42,303.86	2,979,460,972	38,104.12	2,683,673,227	0.57
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	122,871	21,062.85	2,588,013,835	21,087.06	2,590,987,854	0.55

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	56,126	48,326.23	2,712,357,942	45,492.34	2,553,302,833	0.55
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	27,834	82,021.18	2,282,977,497	90,885.56	2,529,708,788	0.54
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	176,126	14,505.17	2,554,737,330	14,143.50	2,491,037,658	0.53
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	28,817	70,567.90	2,033,555,169	84,624.64	2,438,628,178	0.52
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	115,103	17,273.75	1,988,260,416	21,116.98	2,430,627,288	0.52
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	285,588	8,328.21	2,378,437,891	8,258.83	2,358,622,884	0.51
フランス	株式	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	耐久消費財・アパレル	19,127	103,145.98	1,972,873,089	120,510.44	2,305,003,185	0.49
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	94,583	24,318.54	2,300,120,730	24,146.23	2,283,822,862	0.49
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	390,323	6,563.66	2,561,947,621	5,391.94	2,104,598,743	0.45



アメリカ	株式	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	27,288	72,400.59	1,975,667,364	75,173.38	2,051,331,305	0.44
------	----	---------------------------------	------------------------	--------	-----------	---------------	-----------	---------------	------

□ 種類別・業種別投資比率

2023年3月31日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式(外国)	エネルギー	5.19
	素材	4.29
	資本財	6.65
	商業・専門サービス	1.55
	運輸	1.78
	自動車・自動車部品	1.91
	耐久消費財・アパレル	1.75
	消費者サービス	2.08
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.02
	生活必需品流通・小売り	1.81
	食品・飲料・タバコ	4.21
	家庭用品・パーソナル用品	1.82
	ヘルスケア機器・サービス	4.59
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.76
	銀行	5.39
	金融サービス	6.46
	保険	3.11
	ソフトウェア・サービス	8.55
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.56
	半導体・半導体製造装置	5.22
電気通信サービス	1.42	
公益事業	3.04	
メディア・娯楽	5.27	
不動産管理・開発	0.31	
投資証券	-	2.20
合計		97.92

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)

2023年3月31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	12,450,000	12,412.01	1,545,295,754	12,473.04	1,552,893,143	1.625	2026/05/15	1.01

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,200,000	12,708.72	1,042,114,855	12,743.44	1,044,961,715	2.250	2026/03/31	0.68
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	51,000,000	1,942.94	990,899,249	1,947.72	993,335,180	2.690	2026/08/12	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,500,000	11,210.24	952,870,747	11,188.08	950,986,639	1.125	2031/02/15	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,100,000	12,255.52	870,141,702	12,293.04	872,805,759	1.375	2026/08/31	0.57
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	43,000,000	1,963.83	844,447,467	1,969.64	846,943,782	3.020	2031/05/27	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,500,000	12,956.55	842,175,712	13,025.45	846,654,309	2.125	2024/03/31	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,200,000	11,516.43	829,182,843	11,563.56	832,576,641	0.625	2027/12/31	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,500,000	10,874.28	815,571,195	10,881.09	816,081,948	0.625	2030/05/15	0.53
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	38,000,000	2,096.60	796,709,678	2,108.25	801,134,060	3.720	2051/04/12	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,200,000	12,831.30	795,540,493	12,916.36	800,814,127	1.750	2024/06/30	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	10,993.26	769,528,048	10,994.19	769,593,478	0.875	2030/11/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,000,000	10,819.00	757,330,083	10,829.68	758,077,851	0.625	2030/08/15	0.49
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	39,000,000	1,927.10	751,569,750	1,928.01	751,923,432	2.180	2025/08/25	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,600,000	12,927.31	723,929,156	12,989.40	727,406,277	2.375	2024/08/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	12,704.04	724,130,519	12,638.88	720,416,248	2.875	2032/05/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	11,778.28	706,696,842	11,796.71	707,802,471	1.375	2028/10/31	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	13,309.67	705,412,729	13,328.43	706,406,815	3.875	2026/01/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	12,711.39	699,126,359	12,777.62	702,769,057	1.500	2024/10/31	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,900,000	11,577.45	683,069,643	11,618.85	685,511,907	1.000	2028/07/31	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,900,000	11,572.64	682,786,026	11,614.71	685,267,681	0.750	2028/01/31	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	12,879.37	656,847,823	12,921.83	659,013,413	2.250	2024/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,200,000	12,510.56	650,549,079	12,609.37	655,687,314	0.750	2024/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,600,000	14,066.91	647,077,834	13,955.89	641,970,845	4.125	2032/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	11,574.25	636,583,577	11,547.94	635,136,780	1.625	2031/05/15	0.41

ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,100,000	12,402.81	632,543,416	12,331.26	628,894,441	0.000	2030/08/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	12,501.21	625,060,606	12,525.38	626,269,053	2.000	2026/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	12,422.43	621,121,471	12,416.15	620,807,676	2.375	2029/03/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	11,680.67	619,075,524	11,658.77	617,914,882	1.875	2032/02/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	12,785.50	613,703,880	12,775.75	613,235,990	2.750	2028/02/15	0.40

## □ 種類別投資比率

2023年3月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.61
合計	98.61

### 投資不動産物件

#### 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

該当事項はありません。

#### 国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

#### 外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

#### 外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

#### 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

2023年3月31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0506 月2023年6月	買建	275	日本・円	5,418,944,400	5,509,625,000	2.37

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

#### 国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

#### 外国株式インデックス・マザーファンド

2023年3月31日現在

種類	国/ 地域	取引 所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価 (円)	評価額	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価 指数 先物 取引	イギ リス	IC E- EU	FTS E 10 0 ID X FU T JU N 23 2023年6月	買建	36	イギリ ス・ポ ンド	2,706,632.00	448,109,993	2,744,640.00	454,402,598	0.10
	ドイ ツ	EU RE X	EUR O ST OXX 50 J UN 23 2023年6月	買建	255	ユーロ	10,411,025.00	1,517,094,563	10,791,600.00	1,572,551,952	0.34
	アメ リカ	シカ ゴ商 品取 引所	S & P 500 EMIN I FU T JU N 23 2023年6月	買建	273	アメリ カ・ド ル	53,926,169.00	7,200,761,346	55,692,000.00	7,436,552,760	1.59
	オー スト ラリ ア	シド ニー 先物 取引 所	SPI 200 FUTU RES JUN 2 3 2023年 6月	買建	22	オー スト ラリ ア・ド ル	3,880,699.00	348,059,893	3,927,000.00	352,212,630	0.08

(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。

2023年3月31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	11,713,000.00	1,540,125,301	1,563,300,406	0.33
	ユーロ	買建	2,207,000.00	317,506,381	321,488,793	0.07
	イギリス・ポンド	買建	619,000.00	100,856,158	102,434,712	0.02
	カナダ・ドル	買建	547,000.00	52,793,759	53,995,135	0.01
	スイス・フラン	買建	355,000.00	50,660,204	51,880,339	0.01
	香港・ドル	買建	2,193,000.00	36,655,995	37,293,500	0.01
	デンマーク・クローネ	買建	1,313,000.00	25,083,814	25,676,634	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。

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。

参考情報

基準日:2023年3月31日

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

## 基準価額・純資産の推移

## 分配の推移

### ■マイパッケージNEXT30



決算期	分配金
2023年2月	0円
2022年2月	0円
2021年2月	0円
2020年2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

### ■マイパッケージNEXT50



決算期	分配金
2023年2月	0円
2022年2月	0円
2021年2月	0円
2020年2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

### ■マイパッケージNEXT70



決算期	分配金
2023年2月	0円
2022年2月	0円
2021年2月	0円
2020年2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

## 主要な資産の状況

### ■マイパッケージNEXT30

#### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	95.24
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4.76
合計(純資産総額)		100.00

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	54.36
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	20.40
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	10.36
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	10.13

### ■マイパッケージNEXT50

#### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	95.06
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4.94
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)	35.37
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	34.33
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	15.36
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	10.01

### ■マイパッケージNEXT70

#### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	95.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4.90
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)	50.20
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	20.34
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	14.61
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	9.94

※比率は、ファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

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



## ■国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	日本	97.61
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.39
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 2.37%

## 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	3.50
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2.88
日本	株式	キーエンス	電気機器	2.19
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.77
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.73
日本	株式	第一三共	医薬品	1.43
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1.31
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.29
日本	株式	日立製作所	電気機器	1.21
日本	株式	信越化学工業	化学	1.21

## ■国内債券パッシブ・マザーファンド

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	日本	78.61
地方債証券	日本	7.76
特殊債券	日本	7.46
社債券	日本	5.26
	フランス	0.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.75
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	国債証券	444 2年国債	0.005	2025/01/01	2.52
日本	国債証券	363 10年国債	0.100	2031/06/20	1.30
日本	国債証券	147 5年国債	0.005	2026/03/20	1.08
日本	国債証券	156 5年国債	0.200	2027/12/20	1.05
日本	国債証券	149 5年国債	0.005	2026/09/20	1.02
日本	国債証券	150 5年国債	0.005	2026/12/20	1.01
日本	国債証券	145 5年国債	0.100	2025/09/20	0.98
日本	国債証券	153 5年国債	0.005	2027/06/20	0.94
日本	国債証券	148 5年国債	0.005	2026/06/20	0.93
日本	国債証券	362 10年国債	0.100	2031/03/20	0.93

## ■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	66.38
	イギリス	4.28
	カナダ	3.55
	フランス	3.45
	スイス	3.27
	ドイツ	2.59
	その他	12.19
投資証券	アメリカ・その他	2.20
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.08
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 2.10%

## 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	5.11
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	3.98
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・ サービス流通・小売り	1.85
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	1.33
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	1.19
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1.09
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	1.04
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	0.93
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	0.89
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	0.87

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

## ■外国債券パッシブ・マザーファンド

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	アメリカ	48.90
	フランス	8.38
	イタリア	7.59
	ドイツ	6.49
	スペイン	5.02
	イギリス	4.79
	中国	4.57
	その他	12.87
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.39
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2026/05/15	1.01
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2026/03/31	0.68
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.690	2026/08/12	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.125	2031/02/15	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	2026/08/31	0.57
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	3.020	2031/05/27	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.125	2024/03/31	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.625	2027/12/31	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.625	2030/05/15	0.53
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	3.720	2051/04/12	0.52

※比率は、マザーファンドの純資産総額に対する時価の比率です。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)

## ■マイパッケージNEXT30



## ■マイパッケージNEXT50



## ■マイパッケージNEXT70



※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。

※2023年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。

※ベンチマーク(合成指数)の情報は参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込(販売)手続等】

## イ 申込方法

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



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

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

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

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

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

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

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

#### ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

#### ハ 申込手数料

ありません。

#### ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社にお問い合わせください。

#### ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

#### ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

#### ト 払込期日

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

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

## 2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

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

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

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### イ 基準価額の算出方法

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

< 主要投資対象の評価方法 >

主要投資対象	有価証券等の評価方法
株式、投資証券、債券等	(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 原則として、金融商品取引所、外国金融商品市場の最終相場で評価します。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 原則として、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価します。
市場デリバティブ取引	原則として、金融商品取引所、外国金融商品市場の発表する清算値段または最終相場で評価します。

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

##### ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

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

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

## (2)【保管】

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

## (3)【信託期間】

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

## (4)【計算期間】

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

## (5)【その他】

### イ 信託の終了

#### (イ) 信託契約の解約

- a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記aの事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- 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。

- (八) 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、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- (二) 書面決議は議決権を行行使う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(二)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。

## ニ 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

## ホ 販売会社との契約の更改等

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

## ヘ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

## ト 公告

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

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

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

## チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

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

## 4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

### イ 分配金請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に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4期(2022年2月19日から2023年2月20日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【三井住友D S ・年金バランス30（債券重点型）】

## （1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 （2022年 2月18日現在）	第4期 （2023年 2月20日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	344,040	1,641,068
コール・ローン	11,409,409	32,452,817
親投資信託受益証券	232,115,670	662,358,773
未収入金	1,100,000	1,000
流動資産合計	244,969,119	696,453,658
資産合計	244,969,119	696,453,658
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	557,362	502
未払受託者報酬	26,723	74,214
未払委託者報酬	160,500	445,486
その他未払費用	7,984	22,283
流動負債合計	752,569	542,485
負債合計	752,569	542,485
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	221,385,852	627,834,497
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	22,830,698	68,076,676
（分配準備積立金）	7,500,302	13,342,298
元本等合計	244,216,550	695,911,173
純資産合計	244,216,550	695,911,173
負債純資産合計	244,969,119	696,453,658



## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第3期		第4期	
	自 2021年 2月19日	至 2022年 2月18日	自 2022年 2月19日	至 2023年 2月20日
営業収益				
受取利息		60		237
有価証券売買等損益		2,073,733		1,187,103
営業収益合計		2,073,793		1,187,340
営業費用				
支払利息		7,007		11,651
受託者報酬		46,978		121,181
委託者報酬		281,951		727,474
その他費用		14,980		37,128
営業費用合計		350,916		897,434
営業利益又は営業損失（ ）		1,722,877		289,906
経常利益又は経常損失（ ）		1,722,877		289,906
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,722,877		289,906
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（ ）		441,561		42,755
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		10,346,220		22,830,698
剰余金増加額又は欠損金減少額		13,633,722		50,989,387
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		13,633,722		50,989,387
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,430,560		6,076,070
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,430,560		6,076,070
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（ ）		22,830,698		68,076,676

## （３）【注記表】

## （重要な会計方針の注記）

項 目	第4期	
	自 2022年2月19日 至 2023年2月20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. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い 当計算期間は当期末が休日のため、2022年2月19日から2023年2月20日までとなっております。</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3期	第4期
	(2022年2月18日現在)	(2023年2月20日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	221,385,852口	627,834,497口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1031円 (1万口当たりの純資産額11,031円)	1口当たり純資産額 1.1084円 (1万口当たりの純資産額11,084円)

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

項 目	第3期	第4期
	自 2021年2月19日 至 2022年2月18日	自 2022年2月19日 至 2023年2月20日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（2,371,146円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（15,330,396円）、および分配準備積立金（5,129,156円）より、分配対象収益は22,830,698円（1万口当たり1,031.26円）ですが、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（6,590,549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（55,715,441円）、および分配準備積立金（6,751,749円）より、分配対象収益は69,057,739円（1万口当たり1,099.94円）ですが、分配を行っておりません。</p>

## （金融商品に関する注記）

## ・金融商品の状況に関する事項

項 目	第4期 自 2022年2月19日 至 2023年2月20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4期 (2023年2月20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3期(自 2021年2月19日 至 2022年2月18日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	945,539円
合計	945,539円

第4期(自 2022年2月19日 至 2023年2月20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	659,656円
合計	659,656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4期 自 2022年2月19日 至 2023年2月20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3期 (2022年2月18日現在)	第4期 (2023年2月20日現在)
期首元本額	119,003,460円	221,385,852円
期中追加設定元本額	128,773,003円	462,903,268円
期中一部解約元本額	26,390,611円	56,454,623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)	40,587,104	139,522,228	
	外国株式インデックス・マザーファン ド	11,428,893	71,125,429	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	36,230,420	70,268,899	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	314,254,587	381,442,217	
	親投資信託受益証券 小計		662,358,773	
合 計			662,358,773	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【三井住友D S ・年金バランス50(標準型)】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第3期 (2022年 2月18日現在)	第4期 (2023年 2月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	1,051,821	5,213,534
コール・ローン	34,881,580	103,099,832
親投資信託受益証券	682,691,935	2,038,171,740
未収入金	300,000	-
流動資産合計	718,925,336	2,146,485,106
資産合計	718,925,336	2,146,485,106
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	332,091	855,363
未払受託者報酬	75,116	215,301
未払委託者報酬	450,836	1,292,091
その他未払費用	22,534	64,779
流動負債合計	880,577	2,427,534
負債合計	880,577	2,427,534
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	606,200,973	1,761,328,888
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	111,843,786	382,728,684
(分配準備積立金)	35,793,190	74,815,903
元本等合計	718,044,759	2,144,057,572
純資産合計	718,044,759	2,144,057,572
負債純資産合計	718,925,336	2,146,485,106

## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第3期		第4期	
	自	2021年 2月19日	自	2022年 2月19日
	至	2022年 2月18日	至	2023年 2月20日
営業収益				
受取利息		185		686
有価証券売買等損益		11,207,239		45,052,805
営業収益合計		11,207,424		45,053,491
営業費用				
支払利息		19,732		34,135
受託者報酬		128,740		345,141
委託者報酬		772,507		2,071,384
その他費用		41,379		106,306
営業費用合計		962,358		2,556,966
営業利益又は営業損失（ ）		10,245,066		42,496,525
経常利益又は経常損失（ ）		10,245,066		42,496,525
当期純利益又は当期純損失（ ）		10,245,066		42,496,525
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		1,618,601		979,970
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		44,009,397		111,843,786
剰余金増加額又は欠損金減少額		66,781,340		245,148,371
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		66,781,340		245,148,371
剰余金減少額又は欠損金増加額		7,573,416		15,780,028
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		7,573,416		15,780,028
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（ ）		111,843,786		382,728,684

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第4期	
	自 2022年2月19日 至 2023年2月20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. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い 当計算期間は当期末が休日のため、2022年2月19日から2023年2月20日までとなっております。</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3期	第4期
	(2022年2月18日現在)	(2023年2月20日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	606,200,973口	1,761,328,888口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1845円 (1万口当たりの純資産額11,845円)	1口当たり純資産額 1.2173円 (1万口当たりの純資産額12,173円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第3期	第4期
	自 2021年2月19日 至 2022年2月18日	自 2022年2月19日 至 2023年2月20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(7,586,050円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(1,040,415円)、収益調整金(76,050,596円)、および分配準備積立金(27,166,725円)より、分配対象収益は111,843,786円(1万口当たり1,845.00円)ですが、分配を行っていません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(23,723,398円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(17,793,157円)、収益調整金(307,912,781円)、および分配準備積立金(33,299,348円)より、分配対象収益は382,728,684円(1万口当たり2,172.95円)ですが、分配を行っていません。</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	<p style="text-align: center;">第4期 自 2022年2月19日 至 2023年2月20日</p>
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

<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	第4期 (2023年2月20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3期（自 2021年2月19日 至 2022年2月18日）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	8,739,129円

合計	8,739,129円
----	------------

## 第4期(自 2022年2月19日 至 2023年2月20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	42,963,501円
合計	42,963,501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4期 自 2022年2月19日 至 2023年2月20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3期	第4期
	(2022年2月18日現在)	(2023年2月20日現在)
期首元本額	291,333,032円	606,200,973円
期中追加設定元本額	361,775,633円	1,237,975,860円
期中一部解約元本額	46,907,692円	82,847,945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)	218,482,974	751,057,071	
	外国株式インデックス・マザーファン ド	52,455,481	326,446,194	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	110,716,800	214,735,233	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	614,543,782	745,933,242	
	親投資信託受益証券 小計		2,038,171,740	
合 計			2,038,171,740	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【三井住友D S ・年金バランス70 (株式重点型)】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第3期 (2022年 2月18日現在)	第4期 (2023年 2月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	709,318	3,528,679
コール・ローン	23,523,145	69,781,115
親投資信託受益証券	452,603,237	1,395,094,523
未収入金	500,000	175,000
流動資産合計	477,335,700	1,468,579,317
資産合計	477,335,700	1,468,579,317
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	192,592	8,402
未払受託者報酬	51,007	144,018
未払委託者報酬	306,218	864,337
その他未払費用	15,287	43,315
流動負債合計	565,104	1,060,072
負債合計	565,104	1,060,072
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	376,324,099	1,102,940,240
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	100,446,497	364,579,005
( 分配準備積立金 )	30,719,562	81,296,098
元本等合計	476,770,596	1,467,519,245
純資産合計	476,770,596	1,467,519,245
負債純資産合計	477,335,700	1,468,579,317

## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第3期		第4期	
	自	2021年 2月19日	自	2022年 2月19日
	至	2022年 2月18日	至	2023年 2月20日
営業収益				
受取利息		123		452
有価証券売買等損益		11,487,876		56,261,286
営業収益合計		11,487,999		56,261,738
営業費用				
支払利息		13,020		22,706
受託者報酬		85,706		231,950
委託者報酬		514,347		1,392,212
その他費用		27,476		71,358
営業費用合計		640,549		1,718,226
営業利益又は営業損失（ ）		10,847,450		54,543,512
経常利益又は経常損失（ ）		10,847,450		54,543,512
当期純利益又は当期純損失（ ）		10,847,450		54,543,512
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		1,551,219		1,427,357
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		37,732,022		100,446,497
剰余金増加額又は欠損金減少額		62,559,370		228,647,471
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		62,559,370		228,647,471
剰余金減少額又は欠損金増加額		9,141,126		17,631,118
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		9,141,126		17,631,118
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（ ）		100,446,497		364,579,005

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第4期	
	自 2022年2月19日 至 2023年2月20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. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い 当計算期間は当期末が休日のため、2022年2月19日から2023年2月20日までとなっております。</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3期	第4期
	(2022年2月18日現在)	(2023年2月20日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	376,324,099口	1,102,940,240口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2669円 (1万口当たりの純資産額12,669円)	1口当たり純資産額 1.3306円 (1万口当たりの純資産額13,306円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第3期	第4期
	自 2021年2月19日 至 2022年2月18日	自 2022年2月19日 至 2023年2月20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(5,815,196円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(3,481,035円)、収益調整金(69,726,935円)、および分配準備積立金(21,423,331円)より、分配対象収益は100,446,497円(1万口当たり2,669.15円)ですが、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(18,999,878円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(34,116,277円)、収益調整金(283,282,907円)、および分配準備積立金(28,179,943円)より、分配対象収益は364,579,005円(1万口当たり3,305.52円)ですが、分配を行っておりません。</p>
----------	--	---

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項 目	<p style="text-align: center;">第4期 自 2022年2月19日 至 2023年2月20日</p>
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

<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	第4期 (2023年2月20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3期（自 2021年2月19日 至 2022年2月18日）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	9,451,328円



合計	9,451,328円
----	------------

## 第4期(自 2022年2月19日 至 2023年2月20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	53,969,395円
合計	53,969,395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4期 自 2022年2月19日 至 2023年2月20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3期 (2022年2月18日現在)	第4期 (2023年2月20日現在)
期首元本額	175,175,655円	376,324,099円
期中追加設定元本額	241,009,796円	790,507,406円
期中一部解約元本額	39,861,352円	63,891,265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)	213,292,698	733,214,978	
	外国株式インデックス・マザーファン ド	47,972,323	298,546,157	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	75,508,558	146,448,848	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	178,682,271	216,884,540	
	親投資信託受益証券 小計		1,395,094,523	
合 計			1,395,094,523	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

## (1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2022年2月18日現在)	(2023年2月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	83,758,164	91,354,068
コール・ローン	2,777,675,310	1,806,565,228
株式	199,369,314,880	227,099,948,860
派生商品評価勘定	30,794,600	71,296,200
未収配当金	309,642,705	386,632,074
差入委託証拠金	127,995,000	85,050,000
流動資産合計	202,699,180,659	229,540,846,430
資産合計	202,699,180,659	229,540,846,430
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	31,221,600	-
前受金	10,130,000	60,195,000
未払解約金	98,843,866	207,364,628
その他未払費用	4,873	4,022
流動負債合計	140,200,339	267,563,650
負債合計	140,200,339	267,563,650
純資産の部		
元本等		
元本	62,902,449,020	66,694,933,603
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	139,656,531,300	162,578,349,177
元本等合計	202,558,980,320	229,273,282,780
純資産合計	202,558,980,320	229,273,282,780
負債純資産合計	202,699,180,659	229,540,846,430

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年2月19日 至 2023年2月20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	（2022年2月18日現在）	（2023年2月20日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	62,902,449,020口	66,694,933,603口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.2202円 （1万口当たりの純資産額32,202円）	1口当たり純資産額 3.4376円 （1万口当たりの純資産額34,376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 2022年2月19日 至 2023年2月20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	(2023年2月20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）

（2022年2月18日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物 0403月	3,266,127,000	-	3,265,700,000	427,000
	小計	3,266,127,000	-	3,265,700,000	427,000
合 計		3,266,127,000	-	3,265,700,000	427,000

（2023年2月20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 0503月	2,087,623,800	-	2,158,920,000	71,296,200
	小計	2,087,623,800	-	2,158,920,000	71,296,200
合 計		2,087,623,800	-	2,158,920,000	71,296,200

（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 2022年2月19日 至 2023年2月20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)

(2022年2月18日現在)

## 開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	60,820,017,437円
同期中における追加設定元本額	11,487,243,977円
同期中における一部解約元本額	9,404,812,394円
2022年2月18日現在の元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,520,834,455円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	951,877,317円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,478,037,849円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,395,171,931円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	127,138,615円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	4,726,830円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	21,334,615円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	65,507,861円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	154,129,074円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	131,613,738円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	235,373,969円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,444,332,755円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	19,077,187,540円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	372,665,266円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	429,325,888円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	276,656,842円
イオン・バランス戦略ファンド	7,275,121円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	31,464,038円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	172,024,760円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	157,517,509円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	545,398,972円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	291,040,173円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	334,763,476円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	38,178,840円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	493,124,501円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	15,201,309円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	78,234,236円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	74,185,345円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	4,134,560円
日興FWS・日本株インデックス	538,422,236円
三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド	4,292,616円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,783,565,189円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	14,345,131円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型 <適格機関投資家限定>	102,021,389円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	1,801,728,322円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	1,641,765,844円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	6,244,629,351円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	41,484,094円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	165,970,889円
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	725,009,629円

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 >	47,231,431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 >	836,648,839円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	607,228,831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 >	1,892,033,496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 >	41,957,007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 >	47,526,234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 >	34,199,513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 >	16,944,296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 >	112,116,903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 >	243,725,102円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	60,760,917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 >	39,691,119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 >	7,467,207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 >	45,936,567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 >	609,118,916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 )	180,317,730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 >	206,061,152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 >	60,728,009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 >	54,286,476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 >	47,217,544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 >	60,182,914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 >	43,247,408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 >	9,321,771円
合 計	62,902,449,020円

( 2023年2月20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	62,902,449,020円
同期中における追加設定元本額	11,516,103,947円
同期中における一部解約元本額	7,723,619,364円

## 2023年2月20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	9,538,705,047円
三井住友・D C 年金バランス 3 0 ( 債券重点型 )	1,046,654,371円
三井住友・D C 年金バランス 5 0 ( 標準型 )	4,623,835,621円
三井住友・D C 年金バランス 7 0 ( 株式重点型 )	3,605,644,771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 )	147,761,638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 )	4,345,488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 )	20,012,677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 )	64,767,362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 )	167,250,433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 )	153,122,393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 )	269,345,967円

国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,348,113,012円
三井住友・D CつみたてN I S A・日本株インデックスファンド	23,030,551,462円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	299,747,190円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	374,945,391円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	240,188,472円
イオン・バランス戦略ファンド	76,636,609円
三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2 0 5 0	46,120,874円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	202,062,283円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	189,680,711円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	708,126,037円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	397,110,891円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	452,733,238円
三井住友・D CつみたてN I S A・世界分散ファンド	52,873,871円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	864,398,532円
三井住友D S・年金バランス3 0(債券重点型)	40,587,104円
三井住友D S・年金バランス5 0(標準型)	218,482,974円
三井住友D S・年金バランス7 0(株式重点型)	213,292,698円
三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2 0 6 0	5,969,579円
日興F W S・日本株インデックス	1,480,422,415円
三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド	23,888,431円
三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2 0 3 5	48,704円
三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2 0 4 0	55,576円
三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2 0 4 5	66,034円
三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2 0 5 5	75,894円
三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2 0 6 5	75,894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)	2,474,878,301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>	10,250,775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>	66,570,035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>	1,343,208,711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>	1,399,810,680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>	5,379,538,379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>	35,485,948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>	129,345,747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>	649,463,451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>	235,268,102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>	755,439,439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>	516,776,916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>	1,580,224,876円
S M A M・バランスV A株4 0 T <適格機関投資家限定>	352,709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>	34,600,904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>	39,166,060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>	30,431,766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>	16,165,009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>	93,119,594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>	217,333,061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>	50,002,197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>	37,859,485円



SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	7,534,461円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	38,647,210円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	509,415,497円
SMAM・国内株式インデックスファンド・VA(適格機関投資家専用)	161,677,856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>	195,183,336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>	81,328,537円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	88,233,756円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	41,808,540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>	38,301,054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>	25,100,514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>	32,264,198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>	411,569,060円
SMDAM・日米3資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	16,759,020円
合計	66,694,933,603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	4,100	3,630.000	14,883,000	
ニッスイ	110,400	544.000	60,057,600	
マルハニチロ	16,500	2,443.000	40,309,500	
雪国まいたけ	11,000	1,007.000	11,077,000	
カネコ種苗	4,900	1,670.000	8,183,000	
サカタのタネ	12,700	4,045.000	51,371,500	
ホクト	9,700	1,881.000	18,245,700	
住石ホールディングス	16,800	383.000	6,434,400	
日鉄鉱業	4,500	3,530.000	15,885,000	
三井松島ホールディングス	5,200	3,790.000	19,708,000	
INPEX	409,100	1,426.000	583,376,600	
石油資源開発	12,800	4,845.000	62,016,000	
K&Oエナジーグループ	5,400	2,198.000	11,869,200	
ショーボンドホールディングス	15,100	5,260.000	79,426,000	
ミライト・ワン	38,000	1,504.000	57,152,000	
タマホーム	7,000	3,215.000	22,505,000	
日本アクア	5,200	950.000	4,940,000	
安藤・間	63,600	872.000	55,459,200	
東急建設	33,200	671.000	22,277,200	
コムシスホールディングス	37,200	2,486.000	92,479,200	
ビーアールホールディングス	22,600	342.000	7,729,200	
高松コンストラクショングループ	7,300	1,982.000	14,468,600	
東建コーポレーション	3,100	7,600.000	23,560,000	
ヤマウラ	6,800	1,052.000	7,153,600	
オリエンタル白石	43,200	316.000	13,651,200	

大成建設	77,000	4,375.000	336,875,000
大林組	275,900	978.000	269,830,200
清水建設	232,100	733.000	170,129,300
飛島建設	10,100	1,065.000	10,756,500
長谷工コーポレーション	79,600	1,539.000	122,504,400
銭高組	2,100	2,959.000	6,213,900
鹿島建設	171,400	1,607.000	275,439,800
不動テトラ	5,400	1,623.000	8,764,200
大末建設	3,800	1,174.000	4,461,200
鉄建建設	6,700	1,788.000	11,979,600
西松建設	13,300	3,555.000	47,281,500
三井住友建設	64,900	421.000	27,322,900
大豊建設	3,400	3,900.000	13,260,000
奥村組	12,500	3,235.000	40,437,500
東鉄工業	10,500	2,761.000	28,990,500
浅沼組	6,400	3,255.000	20,832,000
戸田建設	96,200	710.000	68,302,000
熊谷組	13,200	2,751.000	36,313,200
北野建設	2,600	2,956.000	7,685,600
矢作建設工業	11,300	819.000	9,254,700
ピーエス三菱	10,900	642.000	6,997,800
日本ハウスホールディングス	18,600	398.000	7,402,800
新日本建設	10,900	871.000	9,493,900
東亜道路工業	1,700	6,440.000	10,948,000
日本道路	1,700	6,760.000	11,492,000
東亜建設工業	7,100	2,606.000	18,502,600
日本国土開発	24,900	552.000	13,744,800
若築建設	3,700	2,998.000	11,092,600
東洋建設	25,600	908.000	23,244,800
五洋建設	110,900	660.000	73,194,000
世紀東急工業	10,700	800.000	8,560,000
福田組	3,100	4,415.000	13,686,500
住友林業	59,300	2,640.000	156,552,000
日本基礎技術	7,700	536.000	4,127,200
巴コーポレーション	13,700	411.000	5,630,700
大和ハウス工業	216,400	3,114.000	673,869,600
ライト工業	14,200	1,974.000	28,030,800
積水ハウス	242,500	2,545.500	617,283,750
日特建設	8,200	931.000	7,634,200
ユアテック	17,300	758.000	13,113,400
日本リーテック	6,300	870.000	5,481,000
四電工	3,600	1,848.000	6,652,800
中電工	10,800	2,129.000	22,993,200
関電工	40,500	877.000	35,518,500
きんでん	53,400	1,509.000	80,580,600
東京エネシス	8,900	906.000	8,063,400
トーエネック	2,800	3,405.000	9,534,000
住友電設	7,200	2,394.000	17,236,800

日本電設工業	12,600	1,501.000	18,912,600
エクシオグループ	35,300	2,399.000	84,684,700
新日本空調	4,300	1,905.000	8,191,500
九電工	19,000	3,405.000	64,695,000
三機工業	16,600	1,486.000	24,667,600
日揮ホールディングス	76,900	1,758.000	135,190,200
中外炉工業	3,400	1,783.000	6,062,200
ヤマト	9,100	805.000	7,325,500
太平電業	4,900	3,825.000	18,742,500
高砂熱学工業	18,400	2,032.000	37,388,800
三晃金属工業	1,500	3,840.000	5,760,000
朝日工業社	3,600	2,104.000	7,574,400
明星工業	14,200	789.000	11,203,800
大気社	9,200	3,515.000	32,338,000
ダイダン	5,300	2,252.000	11,935,600
日比谷総合設備	6,900	2,009.000	13,862,100
テスホールディングス	8,900	1,076.000	9,576,400
インフロニア・ホールディングス	81,300	1,037.000	84,308,100
東洋エンジニアリング	11,600	584.000	6,774,400
レイズネクスト	10,900	1,348.000	14,693,200
ニッポン	19,900	1,596.000	31,760,400
日清製粉グループ本社	71,800	1,561.000	112,079,800
日東富士製粉	1,800	4,455.000	8,019,000
昭和産業	6,400	2,490.000	15,936,000
鳥越製粉	11,600	591.000	6,855,600
中部飼料	11,100	1,036.000	11,499,600
フィード・ワン	12,400	683.000	8,469,200
日本甜菜製糖	5,300	1,638.000	8,681,400
DM三井製糖ホールディングス	7,500	2,046.000	15,345,000
ウェルネオシュガー	4,500	1,675.000	7,537,500
森永製菓	14,500	3,905.000	56,622,500
中村屋	2,700	3,050.000	8,235,000
江崎グリコ	22,200	3,490.000	77,478,000
名糖産業	3,600	1,685.000	6,066,000
井村屋グループ	4,500	2,212.000	9,954,000
不二家	5,300	2,493.000	13,212,900
山崎製パン	52,500	1,587.000	83,317,500
モロゾフ	2,800	3,410.000	9,548,000
亀田製菓	5,000	4,320.000	21,600,000
寿スピリッツ	8,300	8,630.000	71,629,000
カルビー	35,800	2,924.000	104,679,200
森永乳業	14,300	4,820.000	68,926,000
六甲バター	6,100	1,351.000	8,241,100
ヤクルト本社	55,600	9,240.000	513,744,000
明治ホールディングス	48,100	6,420.000	308,802,000
雪印メグミルク	18,600	1,801.000	33,498,600
プリマハム	10,300	2,161.000	22,258,300
日本ハム	30,300	3,770.000	114,231,000

丸大食品	8,600	1,482.000	12,745,200
S Foods	8,700	2,750.000	23,925,000
柿安本店	3,100	2,044.000	6,336,400
伊藤ハム米久ホールディングス	58,100	716.000	41,599,600
サッポロホールディングス	25,700	3,135.000	80,569,500
アサヒグループホールディングス	179,600	4,711.000	846,095,600
キリンホールディングス	350,900	2,006.500	704,080,850
宝ホールディングス	52,500	1,067.000	56,017,500
オエノンホールディングス	26,800	267.000	7,155,600
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	61,000	1,419.000	86,559,000
サントリー食品インターナショナル	54,600	4,740.000	258,804,000
ダイドーグループホールディングス	4,400	4,800.000	21,120,000
伊藤園	26,400	4,450.000	117,480,000
キーコーヒー	8,300	2,074.000	17,214,200
日清オイリオグループ	10,900	3,305.000	36,024,500
不二製油グループ本社	18,300	1,998.000	36,563,400
かどや製油	1,900	3,545.000	6,735,500
J - オイルミルズ	8,200	1,559.000	12,783,800
キッコーマン	51,400	6,520.000	335,128,000
味の素	190,300	4,123.000	784,606,900
ブルドックソース	3,600	1,905.000	6,858,000
キュービー	41,800	2,248.000	93,966,400
ハウス食品グループ本社	23,600	2,689.000	63,460,400
カゴメ	36,200	3,030.000	109,686,000
焼津水産化学工業	8,300	993.000	8,241,900
アリアケジャパン	6,900	4,885.000	33,706,500
ニチレイ	35,800	2,720.000	97,376,000
東洋水産	39,400	5,570.000	219,458,000
イートアンドホールディングス	3,900	2,325.000	9,067,500
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,800	1,021.000	5,921,800
日清食品ホールディングス	27,300	11,380.000	310,674,000
永谷園ホールディングス	4,000	2,095.000	8,380,000
フジッコ	7,700	1,868.000	14,383,600
ロック・フィールド	8,600	1,579.000	13,579,400
日本たばこ産業	511,900	2,788.500	1,427,433,150
ケンコーマヨネーズ	6,000	1,289.000	7,734,000
わらべや日洋ホールディングス	6,200	1,885.000	11,687,000
なとり	5,200	2,045.000	10,634,000
ファーマフーズ	12,200	1,513.000	18,458,600
ユーグレナ	50,900	958.000	48,762,200
紀文食品	6,900	961.000	6,630,900
ピクルスホールディングス	5,000	1,243.000	6,215,000
ミヨシ油脂	6,300	953.000	6,003,900
理研ビタミン	7,100	2,034.000	14,441,400
片倉工業	8,800	1,746.000	15,364,800
グンゼ	6,100	4,365.000	26,626,500
東洋紡	35,200	1,047.000	36,854,400

ユニチカ	30,500	230.000	7,015,000
富士紡ホールディングス	3,300	3,100.000	10,230,000
倉敷紡績	6,500	2,447.000	15,905,500
シキボウ	6,200	1,018.000	6,311,600
日本毛織	21,200	958.000	20,309,600
帝国繊維	9,300	1,593.000	14,814,900
帝人	76,600	1,449.000	110,993,400
東レ	531,000	801.900	425,808,900
ダイニック	9,100	777.000	7,070,700
セーレン	15,300	2,519.000	38,540,700
小松マテーレ	12,800	722.000	9,241,600
ワコールホールディングス	15,400	2,335.000	35,959,000
ホギメディカル	10,800	3,225.000	34,830,000
T S Iホールディングス	30,100	568.000	17,096,800
ワールド	10,900	1,336.000	14,562,400
三陽商会	3,600	1,419.000	5,108,400
オンワードホールディングス	54,600	337.000	18,400,200
ルックホールディングス	2,700	2,162.000	5,837,400
ゴールドウイン	14,000	11,350.000	158,900,000
デサント	13,800	3,925.000	54,165,000
特種東海製紙	4,100	2,947.000	12,082,700
王子ホールディングス	329,000	538.000	177,002,000
日本製紙	43,000	1,007.000	43,301,000
北越コーポレーション	50,300	786.000	39,535,800
大王製紙	35,900	1,077.000	38,664,300
レンゴー	72,800	903.000	65,738,400
トーモク	5,200	1,534.000	7,976,800
ザ・パック	6,100	2,894.000	17,653,400
北の達人コーポレーション	35,900	334.000	11,990,600
クラレ	125,600	1,209.000	151,850,400
旭化成	493,000	954.100	470,371,300
レゾナック・ホールディングス	76,400	2,309.000	176,407,600
住友化学	584,900	477.000	278,997,300
住友精化	3,500	4,215.000	14,752,500
日産化学	37,400	5,890.000	220,286,000
ラサ工業	3,500	2,106.000	7,371,000
クレハ	6,700	8,300.000	55,610,000
多木化学	3,100	4,330.000	13,423,000
テイカ	5,700	1,173.000	6,686,100
石原産業	14,600	1,065.000	15,549,000
片倉コープアグリ	2,900	1,870.000	5,423,000
日本曹達	8,600	4,510.000	38,786,000
東ソー	105,000	1,786.000	187,530,000
トクヤマ	25,500	2,116.000	53,958,000
セントラル硝子	12,900	2,908.000	37,513,200
東亜合成	38,800	1,225.000	47,530,000
大阪ソーダ	4,800	4,215.000	20,232,000
関東電化工業	15,200	1,015.000	15,428,000

デンカ	28,900	2,944.000	85,081,600
信越化学工業	133,400	19,210.000	2,562,614,000
堺化学工業	6,200	1,801.000	11,166,200
第一稀元素化学工業	8,000	1,022.000	8,176,000
エア・ウォーター	74,400	1,620.000	120,528,000
日本酸素ホールディングス	76,300	2,363.000	180,296,900
日本化学工業	3,100	1,977.000	6,128,700
日本パーカライジング	37,800	947.000	35,796,600
高压ガス工業	12,400	662.000	8,208,800
四国化成ホールディングス	9,600	1,283.000	12,316,800
戸田工業	1,800	2,514.000	4,525,200
ステラ ケミファ	4,800	2,518.000	12,086,400
保土谷化学工業	2,400	3,120.000	7,488,000
日本触媒	12,000	5,720.000	68,640,000
大日精化工業	5,700	1,782.000	10,157,400
カネカ	17,800	3,445.000	61,321,000
三菱瓦斯化学	58,400	1,940.000	113,296,000
三井化学	64,900	3,250.000	210,925,000
J S R	74,000	3,105.000	229,770,000
東京応化工業	13,800	7,240.000	99,912,000
大阪有機化学工業	6,000	2,000.000	12,000,000
三菱ケミカルグループ	534,100	812.500	433,956,250
K Hネオケム	13,100	2,625.000	34,387,500
ダイセル	116,300	938.000	109,089,400
住友ベークライト	11,500	4,480.000	51,520,000
積水化学工業	160,900	1,811.000	291,389,900
日本ゼオン	47,400	1,285.000	60,909,000
アイカ工業	19,800	3,030.000	59,994,000
U B E	40,300	2,069.000	83,380,700
積水樹脂	11,200	1,933.000	21,649,600
タキロンシーアイ	17,400	497.000	8,647,800
旭有機材	5,300	2,835.000	15,025,500
ニチバン	5,500	1,806.000	9,933,000
リケンテクノス	17,800	553.000	9,843,400
大倉工業	4,100	1,890.000	7,749,000
積水化成成品工業	6,100	390.000	2,379,000
群栄化学工業	2,200	2,492.000	5,482,400
ミライアル	3,200	1,570.000	5,024,000
ダイキョーニシカワ	18,200	635.000	11,557,000
森六ホールディングス	4,500	1,828.000	8,226,000
恵和	5,200	1,544.000	8,028,800
日本化薬	60,100	1,193.000	71,699,300
カーリットホールディングス	8,400	724.000	6,081,600
日本精化	4,500	2,468.000	11,106,000
扶桑化学工業	7,200	3,645.000	26,244,000
トリケミカル研究所	10,500	2,313.000	24,286,500
A D E K A	26,900	2,128.000	57,243,200
日油	24,300	5,900.000	143,370,000

新日本理化	19,100	214.000	4,087,400
ハリマ化成グループ	6,800	886.000	6,024,800
花王	192,800	5,116.000	986,364,800
第一工業製薬	3,300	1,950.000	6,435,000
石原ケミカル	4,300	1,309.000	5,628,700
三洋化成工業	4,600	4,280.000	19,688,000
有機合成薬品工業	8,100	291.000	2,357,100
大日本塗料	11,000	840.000	9,240,000
日本ペイントホールディングス	350,000	1,257.000	439,950,000
関西ペイント	72,700	1,845.000	134,131,500
中国塗料	13,700	1,087.000	14,891,900
日本特殊塗料	5,700	920.000	5,244,000
藤倉化成	12,900	434.000	5,598,600
太陽ホールディングス	11,800	2,361.000	27,859,800
D I C	30,500	2,429.000	74,084,500
サカタインクス	17,500	1,023.000	17,902,500
東洋インキS Cホールディングス	14,900	1,895.000	28,235,500
T & K T O K A	7,600	1,272.000	9,667,200
富士フイルムホールディングス	151,900	6,419.000	975,046,100
資生堂	165,500	6,153.000	1,018,321,500
ライオン	95,800	1,476.000	141,400,800
高砂香料工業	5,400	2,503.000	13,516,200
マンダム	17,800	1,434.000	25,525,200
ミルボン	11,800	5,820.000	68,676,000
ファンケル	34,800	2,561.000	89,122,800
コーセー	16,100	15,730.000	253,253,000
コタ	6,600	1,670.000	11,022,000
ポーラ・オルビスホールディングス	40,900	1,760.000	71,984,000
ノエビアホールディングス	7,100	5,560.000	39,476,000
新日本製薬	5,100	1,424.000	7,262,400
エステー	6,800	1,548.000	10,526,400
アグロ カネショウ	3,800	1,530.000	5,814,000
コニシ	13,100	1,777.000	23,278,700
長谷川香料	16,400	2,935.000	48,134,000
小林製薬	23,100	8,320.000	192,192,000
荒川化学工業	8,000	984.000	7,872,000
メック	6,600	2,219.000	14,645,400
日本高純度化学	2,400	2,454.000	5,889,600
タカラバイオ	21,400	1,772.000	37,920,800
J C U	8,900	3,065.000	27,278,500
新田ゼラチン	6,200	813.000	5,040,600
O A Tアグリオ	3,600	1,442.000	5,191,200
デクセリアルズ	23,000	2,708.000	62,284,000
アース製薬	7,200	4,860.000	34,992,000
北興化学工業	10,200	823.000	8,394,600
大成ラミック	3,300	2,897.000	9,560,100
クミアイ化学工業	32,200	872.000	28,078,400
日本農薬	15,600	696.000	10,857,600

アキレス	6,300	1,244.000	7,837,200
有沢製作所	13,500	1,400.000	18,900,000
日東電工	57,300	8,390.000	480,747,000
レック	12,200	933.000	11,382,600
三光合成	11,900	546.000	6,497,400
きもと	19,700	200.000	3,940,000
藤森工業	6,000	3,075.000	18,450,000
前澤化成工業	5,900	1,380.000	8,142,000
未来工業	3,400	1,503.000	5,110,200
J S P	5,900	1,590.000	9,381,000
エフピコ	15,200	3,605.000	54,796,000
天馬	6,500	2,307.000	14,995,500
信越ポリマー	14,400	1,349.000	19,425,600
東リ	21,900	270.000	5,913,000
ニフコ	28,500	3,460.000	98,610,000
バルカー	6,400	3,240.000	20,736,000
ユニ・チャーム	165,100	5,059.000	835,240,900
協和キリン	95,400	2,943.000	280,762,200
武田薬品工業	700,900	4,263.000	2,987,936,700
アステラス製薬	758,900	1,886.000	1,431,285,400
住友ファーマ	59,100	868.000	51,298,800
塩野義製薬	101,300	6,160.000	624,008,000
日本新薬	18,700	6,310.000	117,997,000
中外製薬	247,700	3,570.000	884,289,000
科研製薬	13,500	3,640.000	49,140,000
エーザイ	96,500	7,811.000	753,761,500
ロート製薬	76,900	2,582.000	198,555,800
小野薬品工業	152,900	2,851.000	435,917,900
久光製薬	17,700	3,915.000	69,295,500
持田製薬	9,300	3,420.000	31,806,000
参天製薬	149,100	1,006.000	149,994,600
扶桑薬品工業	3,100	1,954.000	6,057,400
ツムラ	24,900	2,630.000	65,487,000
キッセイ薬品工業	12,300	2,519.000	30,983,700
生化学工業	15,500	817.000	12,663,500
栄研化学	13,200	1,566.000	20,671,200
鳥居薬品	4,300	3,255.000	13,996,500
J C Rファーマ	27,200	1,557.000	42,350,400
東和薬品	12,200	1,908.000	23,277,600
富士製薬工業	6,300	1,056.000	6,652,800
ゼリア新薬工業	10,900	2,197.000	23,947,300
第一三共	689,900	4,277.000	2,950,702,300
キョーリン製薬ホールディングス	17,100	1,690.000	28,899,000
大幸薬品	17,900	425.000	7,607,500
ダイト	5,700	2,437.000	13,890,900
大塚ホールディングス	180,900	4,164.000	753,267,600
大正製薬ホールディングス	18,000	5,430.000	97,740,000
ペプチドリーム	38,600	1,875.000	72,375,000



あすか製薬ホールディングス	8,600	1,183.000	10,173,800
サワイグループホールディングス	18,200	3,790.000	68,978,000
日本コークス工業	83,300	88.000	7,330,400
ニチレキ	9,800	1,386.000	13,582,800
ユシロ化学工業	8,700	828.000	7,203,600
富士石油	23,300	252.000	5,871,600
出光興産	87,700	3,075.000	269,677,500
E N E O Sホールディングス	1,430,300	462.600	661,656,780
コスモエネルギーホールディングス	31,400	3,910.000	122,774,000
横浜ゴム	44,800	2,441.000	109,356,800
T O Y O T I R E	45,600	1,599.000	72,914,400
ブリヂストン	252,700	5,222.000	1,319,599,400
住友ゴム工業	78,000	1,230.000	95,940,000
藤倉コンポジット	6,000	979.000	5,874,000
オカモト	4,500	3,910.000	17,595,000
フコク	5,200	1,049.000	5,454,800
ニッタ	7,800	2,929.000	22,846,200
住友理工	16,000	710.000	11,360,000
三ツ星ベルト	11,600	3,870.000	44,892,000
バンドー化学	12,900	1,015.000	13,093,500
日東紡績	10,500	2,109.000	22,144,500
A G C	80,600	4,980.000	401,388,000
日本電気硝子	32,700	2,489.000	81,390,300
オハラ	5,400	1,195.000	6,453,000
住友大阪セメント	11,800	3,830.000	45,194,000
太平洋セメント	51,000	2,460.000	125,460,000
日本ヒューム	10,000	664.000	6,640,000
日本コンクリート工業	23,400	232.000	5,428,800
三谷セキサン	3,700	4,395.000	16,261,500
アジアパイルホールディングス	15,100	635.000	9,588,500
東海カーボン	67,200	1,298.000	87,225,600
日本カーボン	5,000	4,160.000	20,800,000
東洋炭素	5,500	4,270.000	23,485,000
ノリタケカンパニーリミテド	4,500	4,470.000	20,115,000
T O T O	52,300	4,570.000	239,011,000
日本碍子	93,700	1,794.000	168,097,800
日本特殊陶業	60,600	2,736.000	165,801,600
M A R U W A	3,000	17,360.000	52,080,000
品川リフラクトリーズ	2,400	4,300.000	10,320,000
黒崎播磨	1,800	6,590.000	11,862,000
ヨータイ	5,600	1,495.000	8,372,000
東京窯業	15,500	309.000	4,789,500
フジインコーポレーテッド	6,500	6,360.000	41,340,000
ニチアス	20,500	2,589.000	53,074,500
ニチハ	10,500	2,648.000	27,804,000
日本製鉄	364,700	3,097.000	1,129,475,900
神戸製鋼所	163,200	890.000	145,248,000
中山製鋼所	17,400	1,069.000	18,600,600

合同製鐵	4,500	3,415.000	15,367,500
J F Eホールディングス	217,000	1,745.000	378,665,000
東京製鐵	22,900	1,494.000	34,212,600
共英製鋼	9,500	1,550.000	14,725,000
大和工業	13,300	5,270.000	70,091,000
東京鐵鋼	4,500	1,794.000	8,073,000
大阪製鐵	5,000	1,325.000	6,625,000
淀川製鋼所	8,800	2,639.000	23,223,200
中部鋼鉄	7,100	1,958.000	13,901,800
丸一鋼管	24,600	2,823.000	69,445,800
モリ工業	2,400	3,045.000	7,308,000
大同特殊鋼	10,200	5,310.000	54,162,000
日本冶金工業	6,000	4,485.000	26,910,000
山陽特殊製鋼	7,900	2,658.000	20,998,200
愛知製鋼	5,000	2,320.000	11,600,000
大平洋金属	6,200	1,987.000	12,319,400
新日本電工	53,600	374.000	20,046,400
栗本鐵工所	4,400	2,019.000	8,883,600
三菱製鋼	5,900	1,230.000	7,257,000
日本精線	1,300	4,635.000	6,025,500
エンビプロ・ホールディングス	5,700	720.000	4,104,000
新家工業	2,400	2,387.000	5,728,800
大紀アルミニウム工業所	11,700	1,416.000	16,567,200
日本軽金属ホールディングス	22,000	1,448.000	31,856,000
三井金属鉱業	23,700	3,385.000	80,224,500
東邦亜鉛	5,400	2,084.000	11,253,600
三菱マテリアル	54,800	2,142.000	117,381,600
住友金属鉱山	94,600	5,203.000	492,203,800
D O W Aホールディングス	18,400	4,515.000	83,076,000
古河機械金属	12,100	1,378.000	16,673,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	12,200	3,065.000	37,393,000
東邦チタニウム	15,000	2,129.000	31,935,000
U A C J	11,600	2,508.000	29,092,800
C Kサンエツ	2,100	4,215.000	8,851,500
古河電気工業	27,400	2,427.000	66,499,800
住友電気工業	281,500	1,669.500	469,964,250
フジクラ	88,000	966.000	85,008,000
昭和電線ホールディングス	9,400	1,903.000	17,888,200
平河ヒューテック	5,400	1,373.000	7,414,200
リョービ	9,700	1,451.000	14,074,700
アーレスティ	11,100	549.000	6,093,900
アサヒホールディングス	33,100	1,972.000	65,273,200
稲葉製作所	7,000	1,406.000	9,842,000
宮地エンジニアリンググループ	2,400	3,680.000	8,832,000
トーカロ	21,600	1,239.000	26,762,400
アルファ	6,300	987.000	6,218,100
S U M C O	155,000	1,873.000	290,315,000
川田テクノロジーズ	2,300	3,520.000	8,096,000

RS TECHNOLOGIES	5,500	3,550.000	19,525,000
ジェイテックコーポレーション	1,200	2,774.000	3,328,800
信和	9,700	742.000	7,197,400
東洋製罐グループホールディングス	54,100	1,738.000	94,025,800
ホッカンホールディングス	5,400	1,345.000	7,263,000
横河ブリッジホールディングス	10,600	2,029.000	21,507,400
三和ホールディングス	74,400	1,418.000	105,499,200
文化シャッター	23,100	1,145.000	26,449,500
三協立山	10,900	648.000	7,063,200
アルインコ	7,200	1,065.000	7,668,000
LIXIL	118,700	2,138.000	253,780,600
ノーリツ	12,000	1,584.000	19,008,000
長府製作所	8,200	2,101.000	17,228,200
リンナイ	14,800	9,690.000	143,412,000
日東精工	12,800	512.000	6,553,600
岡部	13,500	718.000	9,693,000
ジーテクト	9,000	1,399.000	12,591,000
東プレ	14,100	1,192.000	16,807,200
高周波熱錬	14,100	671.000	9,461,100
東京製綱	5,600	1,235.000	6,916,000
サンコール	7,700	620.000	4,774,000
パイオラックス	11,400	1,929.000	21,990,600
エイチワン	9,300	623.000	5,793,900
日本発条	71,800	898.000	64,476,400
立川ブラインド工業	4,400	1,256.000	5,526,400
三益半導体工業	6,100	2,513.000	15,329,300
日本製鋼所	22,300	2,625.000	58,537,500
三浦工業	33,300	3,340.000	111,222,000
タクマ	24,900	1,384.000	34,461,600
ツガミ	17,800	1,468.000	26,130,400
オークマ	7,800	5,240.000	40,872,000
芝浦機械	8,100	2,899.000	23,481,900
アマダ	126,200	1,199.000	151,313,800
アイダエンジニアリング	17,300	790.000	13,667,000
FUJ I	34,300	2,055.000	70,486,500
牧野フライス製作所	8,800	4,770.000	41,976,000
オーエスジー	38,000	1,928.000	73,264,000
旭ダイヤモンド工業	23,100	765.000	17,671,500
D M G 森精機	48,200	2,154.000	103,822,800
ソディック	22,800	740.000	16,872,000
ディスコ	12,800	40,000.000	512,000,000
日東工器	4,600	1,705.000	7,843,000
日進工具	7,000	1,069.000	7,483,000
パンチ工業	8,400	447.000	3,754,800
豊和工業	5,500	988.000	5,434,000
石川製作所	3,200	1,469.000	4,700,800
島精機製作所	12,700	1,851.000	23,507,700
オプトラン	12,000	2,100.000	25,200,000

NCホールディングス	2,100	1,926.000	4,044,600
イワキ	6,300	1,281.000	8,070,300
フリー	9,200	1,216.000	11,187,200
ヤマシンフィルタ	20,700	405.000	8,383,500
日阪製作所	9,100	929.000	8,453,900
やまびこ	13,400	1,275.000	17,085,000
野村マイクロ・サイエンス	2,700	4,375.000	11,812,500
平田機工	3,900	6,470.000	25,233,000
ベガサスミシン製造	9,900	672.000	6,652,800
マルマエ	4,300	1,896.000	8,152,800
タツモ	4,800	1,674.000	8,035,200
ナブテスコ	50,100	3,525.000	176,602,500
三井海洋開発	10,300	1,528.000	15,738,400
レオン自動機	9,100	1,212.000	11,029,200
S M C	25,900	66,940.000	1,733,746,000
ホソカワミクロン	6,100	2,630.000	16,043,000
ユニオンツール	3,500	3,235.000	11,322,500
オイレス工業	11,000	1,625.000	17,875,000
日精エー・エス・ビー機械	3,700	4,340.000	16,058,000
サトーホールディングス	11,400	2,309.000	26,322,600
技研製作所	8,400	2,802.000	23,536,800
日本エアテック	5,200	1,095.000	5,694,000
日精樹脂工業	7,100	972.000	6,901,200
ワイエイシイホールディングス	3,300	2,300.000	7,590,000
小松製作所	373,700	3,307.000	1,235,825,900
住友重機械工業	46,900	2,946.000	138,167,400
日立建機	31,600	3,115.000	98,434,000
日工	13,300	627.000	8,339,100
巴工業	3,900	2,427.000	9,465,300
井関農機	8,300	1,182.000	9,810,600
T O W A	8,200	1,831.000	15,014,200
ローツェ	4,200	10,270.000	43,134,000
クボタ	422,100	2,086.000	880,500,600
荏原実業	4,000	2,924.000	11,696,000
三菱化工機	3,100	2,221.000	6,885,100
月島機械	11,600	1,116.000	12,945,600
帝国電機製作所	6,100	2,594.000	15,823,400
新東工業	17,400	754.000	13,119,600
澁谷工業	7,400	2,408.000	17,819,200
アイチコーポレーション	11,900	777.000	9,246,300
小森コーポレーション	19,200	871.000	16,723,200
鶴見製作所	6,600	1,983.000	13,087,800
酒井重工業	1,500	3,790.000	5,685,000
荏原製作所	32,500	5,590.000	181,675,000
西島製作所	7,600	1,535.000	11,666,000
北越工業	8,700	1,385.000	12,049,500
ダイキン工業	95,200	23,350.000	2,222,920,000
オルガノ	10,800	3,380.000	36,504,000

トーヨーカネツ	3,600	2,638.000	9,496,800
栗田工業	44,600	6,030.000	268,938,000
椿本チエイン	11,000	3,095.000	34,045,000
大同工業	6,700	751.000	5,031,700
木村化工機	8,200	735.000	6,027,000
アネスト岩田	14,400	911.000	13,118,400
ダイフク	41,100	7,240.000	297,564,000
サムコ	2,700	3,485.000	9,409,500
タダノ	42,600	1,003.000	42,727,800
フジテック	29,200	3,215.000	93,878,000
C K D	21,900	2,011.000	44,040,900
平和	26,800	2,474.000	66,303,200
理想科学工業	7,300	2,382.000	17,388,600
S A N K Y O	15,800	5,570.000	88,006,000
日本金銭機械	9,500	1,252.000	11,894,000
マースグループホールディングス	5,200	2,481.000	12,901,200
フクシマガリレイ	5,900	4,270.000	25,193,000
ダイコク電機	5,000	2,676.000	13,380,000
竹内製作所	14,500	2,966.000	43,007,000
アマノ	22,700	2,492.000	56,568,400
J U K I	14,400	634.000	9,129,600
ジャノメ	9,800	613.000	6,007,400
マックス	9,700	2,143.000	20,787,100
グローリー	21,200	2,671.000	56,625,200
新晃工業	8,500	1,553.000	13,200,500
大和冷機工業	12,000	1,233.000	14,796,000
セガサミーホールディングス	64,400	2,348.000	151,211,200
リケン	3,700	2,591.000	9,586,700
T P R	9,500	1,370.000	13,015,000
ツバキ・ナカシマ	20,300	1,087.000	22,066,100
ホシザキ	51,400	4,700.000	241,580,000
大豊工業	8,500	647.000	5,499,500
日本精工	146,000	746.000	108,916,000
N T N	158,900	338.000	53,708,200
ジェイテクト	70,800	1,018.000	72,074,400
不二越	5,800	3,860.000	22,388,000
日本トムソン	20,600	594.000	12,236,400
T H K	45,900	2,868.000	131,641,200
ユーシン精機	8,000	729.000	5,832,000
前澤給装工業	6,800	969.000	6,589,200
イーグル工業	9,300	1,173.000	10,908,900
前澤工業	8,400	628.000	5,275,200
日本ピラー工業	7,300	3,340.000	24,382,000
キッツ	30,000	857.000	25,710,000
マキタ	99,300	3,480.000	345,564,000
日立造船	66,000	896.000	59,136,000
三菱重工業	139,700	5,046.000	704,926,200
I H I	50,300	3,630.000	182,589,000

スター精密	14,800	1,639.000	24,257,200
日清紡ホールディングス	65,400	990.000	64,746,000
イビデン	45,700	4,490.000	205,193,000
コニカミノルタ	178,900	602.000	107,697,800
ブラザー工業	106,300	2,011.000	213,769,300
ミネベアミツミ	138,100	2,381.000	328,816,100
日立製作所	387,700	7,050.000	2,733,285,000
東芝	153,700	4,337.000	666,596,900
三菱電機	824,300	1,549.500	1,277,252,850
富士電機	48,300	5,230.000	252,609,000
東洋電機製造	6,800	885.000	6,018,000
安川電機	94,400	5,150.000	486,160,000
シンフォニア テクノロジー	9,000	1,633.000	14,697,000
明電舎	12,400	1,914.000	23,733,600
オリジン	3,700	1,273.000	4,710,100
山洋電気	3,500	5,640.000	19,740,000
デンヨー	6,800	1,583.000	10,764,400
PHCホールディングス	11,200	1,419.000	15,892,800
ソシオネクスト	8,300	8,290.000	68,807,000
東芝テック	12,000	3,860.000	46,320,000
芝浦メカトロニクス	1,500	13,330.000	19,995,000
マブチモーター	19,700	3,750.000	73,875,000
日本電産	194,100	6,932.000	1,345,501,200
トレックス・セミコンダクター	3,900	2,520.000	9,828,000
東光高岳	5,100	2,026.000	10,332,600
ダブル・スコープ	26,500	1,320.000	34,980,000
ダイヘン	7,200	4,245.000	30,564,000
ヤーマン	14,300	1,452.000	20,763,600
JVCケンウッド	74,900	385.000	28,836,500
ミマキエンジニアリング	9,500	557.000	5,291,500
I - P E X	5,300	1,215.000	6,439,500
日新電機	18,600	1,696.000	31,545,600
大崎電気工業	21,800	526.000	11,466,800
オムロン	73,100	7,239.000	529,170,900
日東工業	10,900	2,648.000	28,863,200
I D E C	11,900	3,275.000	38,972,500
ジーエス・ユアサ コーポレーション	26,200	2,479.000	64,949,800
メルコホールディングス	2,300	3,360.000	7,728,000
日本電気	112,800	4,780.000	539,184,000
富士通	79,500	17,510.000	1,392,045,000
沖電気工業	37,400	719.000	26,890,600
電気興業	3,700	2,166.000	8,014,200
サンケン電気	7,400	8,830.000	65,342,000
アイホン	5,300	1,954.000	10,356,200
ルネサスエレクトロニクス	520,600	1,710.500	890,486,300
セイコーエプソン	106,100	1,873.000	198,725,300
ワコム	63,400	661.000	41,907,400
アルバック	18,900	5,270.000	99,603,000

アクセル	3,400	1,767.000	6,007,800
E I Z O	6,000	3,700.000	22,200,000
日本信号	18,100	1,039.000	18,805,900
京三製作所	19,800	409.000	8,098,200
能美防災	10,800	1,656.000	17,884,800
ホーチキ	6,600	1,457.000	9,616,200
エレコム	19,200	1,305.000	25,056,000
パナソニック ホールディングス	942,400	1,180.500	1,112,503,200
シャープ	96,400	977.000	94,182,800
アンリツ	56,800	1,257.000	71,397,600
富士通ゼネラル	22,700	3,760.000	85,352,000
ソニーグループ	558,600	11,440.000	6,390,384,000
T D K	126,300	4,550.000	574,665,000
帝国通信工業	4,200	1,450.000	6,090,000
タムラ製作所	35,500	754.000	26,767,000
アルプスアルパイン	71,800	1,425.000	102,315,000
日本電波工業	10,000	1,422.000	14,220,000
鈴木	5,300	1,019.000	5,400,700
メイコー	8,800	2,752.000	24,217,600
日本トリム	2,200	2,841.000	6,250,200
ローランド ディー . ジー .	4,600	3,115.000	14,329,000
フォスター電機	8,700	947.000	8,238,900
S M K	2,500	2,500.000	6,250,000
ヨコオ	6,500	2,002.000	13,013,000
ホシデン	19,400	1,604.000	31,117,600
ヒロセ電機	13,200	16,950.000	223,740,000
日本航空電子工業	16,300	2,268.000	36,968,400
T O A	10,500	791.000	8,305,500
マクセル	17,800	1,464.000	26,059,200
古野電気	11,300	944.000	10,667,200
スミダコーポレーション	7,800	1,641.000	12,799,800
アイコム	3,400	2,571.000	8,741,400
リオン	3,800	1,853.000	7,041,400
横河電機	87,200	2,071.000	180,591,200
新電元工業	3,400	3,480.000	11,832,000
アズビル	55,100	3,610.000	198,911,000
東亜ディーケーケー	7,600	786.000	5,973,600
日本光電工業	36,700	3,375.000	123,862,500
チノー	4,000	1,924.000	7,696,000
日本電子材料	6,100	1,515.000	9,241,500
堀場製作所	17,500	7,000.000	122,500,000
アドバンテスト	62,100	10,070.000	625,347,000
エスベック	6,600	2,029.000	13,391,400
キーエンス	79,000	58,250.000	4,601,750,000
日置電機	4,100	7,930.000	32,513,000
シスメックス	68,200	8,302.000	566,196,400
日本マイクロニクス	13,100	1,299.000	17,016,900
メガチップス	6,700	2,836.000	19,001,200

OBARA GROUP	4,300	3,840.000	16,512,000
コーセル	10,500	1,085.000	11,392,500
イリソ電子工業	7,400	4,685.000	34,669,000
オブテックスグループ	14,700	2,067.000	30,384,900
千代田インテグレ	3,900	2,175.000	8,482,500
レーザーテック	36,200	22,555.000	816,491,000
スタンレー電気	56,100	2,834.000	158,987,400
岩崎電気	3,100	4,445.000	13,779,500
ウシオ電機	41,200	1,593.000	65,631,600
ヘリオス テクノ ホールディング	9,600	401.000	3,849,600
エノモト	2,300	1,904.000	4,379,200
日本セラミック	8,100	2,696.000	21,837,600
古河電池	6,400	1,148.000	7,347,200
山一電機	7,300	1,793.000	13,088,900
図研	7,000	3,470.000	24,290,000
日本電子	19,700	4,015.000	79,095,500
カシオ計算機	59,100	1,352.000	79,903,200
ファナック	77,500	22,700.000	1,759,250,000
日本シイエムケイ	19,200	497.000	9,542,400
エンプラス	2,600	3,955.000	10,283,000
大真空	10,400	747.000	7,768,800
ローム	36,400	10,500.000	382,200,000
浜松ホトニクス	63,100	6,660.000	420,246,000
三井ハイテック	8,100	6,960.000	56,376,000
新光電気工業	27,800	3,800.000	105,640,000
京セラ	122,700	6,689.000	820,740,300
太陽誘電	38,300	4,185.000	160,285,500
村田製作所	239,300	7,403.000	1,771,537,900
双葉電子工業	18,100	548.000	9,918,800
ニチコン	16,400	1,314.000	21,549,600
日本ケミコン	7,300	2,115.000	15,439,500
KOA	12,300	1,856.000	22,828,800
市光工業	12,900	444.000	5,727,600
小糸製作所	94,600	2,287.000	216,350,200
ミツバ	16,200	507.000	8,213,400
SCREENホールディングス	13,500	10,330.000	139,455,000
キャノン電子	9,200	1,738.000	15,989,600
キャノン	433,500	2,960.500	1,283,376,750
リコー	198,200	1,066.000	211,281,200
象印マホービン	23,700	1,635.000	38,749,500
東京エレクトロン	55,700	45,480.000	2,533,236,000
イノテック	5,800	1,331.000	7,719,800
トヨタ紡織	33,100	2,090.000	69,179,000
ユニプレス	16,100	761.000	12,252,100
豊田自動織機	57,600	7,730.000	445,248,000
モリタホールディングス	14,800	1,190.000	17,612,000
三櫻工業	12,900	679.000	8,759,100
デンソー	162,700	7,386.000	1,201,702,200



東海理化電機製作所	21,900	1,533.000	33,572,700
川崎重工業	59,700	3,025.000	180,592,500
日本車輛製造	3,900	1,952.000	7,612,800
三菱ロジスネクスト	14,800	838.000	12,402,400
日産自動車	1,123,000	524.200	588,676,600
いすゞ自動車	229,200	1,641.000	376,117,200
トヨタ自動車	4,336,200	1,902.500	8,249,620,500
日野自動車	103,400	572.000	59,144,800
三菱自動車工業	309,600	532.000	164,707,200
武蔵精密工業	19,300	1,815.000	35,029,500
日産車体	14,800	883.000	13,068,400
新明和工業	25,500	1,095.000	27,922,500
極東開発工業	14,300	1,453.000	20,777,900
トピー工業	7,400	1,862.000	13,778,800
ティラド	2,400	2,225.000	5,340,000
曙ブレーキ工業	58,200	147.000	8,555,400
タチエス	13,300	1,251.000	16,638,300
N O K	31,100	1,282.000	39,870,200
フタバ産業	23,500	410.000	9,635,000
K Y B	7,600	3,635.000	27,626,000
大同メタル工業	20,100	508.000	10,210,800
プレス工業	35,700	457.000	16,314,900
ミクニ	12,100	348.000	4,210,800
太平洋工業	18,500	1,135.000	20,997,500
アイシン	60,700	3,760.000	228,232,000
マツダ	261,600	1,170.000	306,072,000
今仙電機製作所	6,300	772.000	4,863,600
本田技研工業	641,900	3,460.000	2,220,974,000
スズキ	145,100	4,777.000	693,142,700
S U B A R U	250,400	2,198.000	550,379,200
ヤマハ発動機	123,900	3,375.000	418,162,500
エクセディ	13,200	1,800.000	23,760,000
豊田合成	23,000	2,167.000	49,841,000
愛三工業	14,100	869.000	12,252,900
日本プラスト	14,100	401.000	5,654,100
ヨロズ	9,400	753.000	7,078,200
エフ・シー・シー	13,900	1,471.000	20,446,900
シマノ	32,300	21,900.000	707,370,000
テイ・エス テック	36,100	1,732.000	62,525,200
テルモ	246,700	3,705.000	914,023,500
日機装	20,100	944.000	18,974,400
日本エム・ディ・エム	5,500	1,038.000	5,709,000
島津製作所	95,900	3,855.000	369,694,500
長野計器	6,200	1,207.000	7,483,400
ブイ・テクノロジー	4,100	2,519.000	10,327,900
東京計器	6,900	1,297.000	8,949,300
愛知時計電機	3,800	1,451.000	5,513,800
インターアクション	4,000	1,485.000	5,940,000

オーバル	8,300	468.000	3,884,400
東京精密	17,200	4,785.000	82,302,000
マニー	35,000	1,862.000	65,170,000
ニコン	123,000	1,294.000	159,162,000
トプコン	41,700	1,698.000	70,806,600
オリンパス	493,700	2,295.000	1,133,041,500
理研計器	4,900	4,955.000	24,279,500
タムロン	5,900	3,165.000	18,673,500
HOYA	168,600	13,410.000	2,260,926,000
ノーリツ鋼機	7,700	2,130.000	16,401,000
A & D ホロンホールディングス	11,400	1,257.000	14,329,800
朝日インテック	88,400	2,356.000	208,270,400
シチズン時計	87,000	835.000	72,645,000
リズム	2,900	1,532.000	4,442,800
メニコン	27,300	2,951.000	80,562,300
松風	3,900	2,087.000	8,139,300
セイコーグループ	12,400	2,926.000	36,282,400
ニプロ	66,500	1,086.000	72,219,000
スノーピーク	13,800	2,187.000	30,180,600
パラマウントベッドホールディングス	18,100	2,404.000	43,512,400
トランザクション	6,500	1,509.000	9,808,500
ニホンフラッシュ	8,300	936.000	7,768,800
前田工織	6,800	3,350.000	22,780,000
永大産業	25,600	219.000	5,606,400
アートネイチャー	9,000	749.000	6,741,000
バンダイナムコホールディングス	72,100	8,575.000	618,257,500
SHOEI	8,300	5,150.000	42,745,000
フランスベッドホールディングス	10,800	998.000	10,778,400
パイロットコーポレーション	12,500	4,420.000	55,250,000
萩原工業	6,400	1,215.000	7,776,000
フジシールインターナショナル	16,100	1,616.000	26,017,600
タカラトミー	36,600	1,301.000	47,616,600
広済堂ホールディングス	5,000	2,362.000	11,810,000
プロネクサス	7,900	988.000	7,805,200
ウッドワン	5,000	913.000	4,565,000
大建工業	5,100	2,127.000	10,847,700
凸版印刷	102,600	2,402.000	246,445,200
大日本印刷	93,300	3,640.000	339,612,000
共同印刷	2,700	2,941.000	7,940,700
NISSHA	15,100	1,841.000	27,799,100
TAKARA & COMPANY	5,600	2,175.000	12,180,000
アシックス	72,900	3,270.000	238,383,000
ツツミ	1,200	1,987.000	2,384,400
ローランド	6,000	3,895.000	23,370,000
小松ウオール工業	3,100	1,922.000	5,958,200
ヤマハ	49,500	4,955.000	245,272,500
河合楽器製作所	2,200	2,667.000	5,867,400
クリナップ	9,700	639.000	6,198,300

ピジョン	50,800	2,200.000	111,760,000
キングジム	7,800	886.000	6,910,800
リンテック	15,600	2,196.000	34,257,600
イトーキ	17,400	745.000	12,963,000
任天堂	498,700	5,464.000	2,724,896,800
三菱鉛筆	11,300	1,480.000	16,724,000
タカラスタンド	14,900	1,404.000	20,919,600
コクヨ	38,000	1,849.000	70,262,000
グローブライド	6,300	2,609.000	16,436,700
オカムラ	23,700	1,348.000	31,947,600
美津濃	7,900	3,030.000	23,937,000
東京電力ホールディングス	713,200	480.000	342,336,000
中部電力	290,100	1,450.000	420,645,000
関西電力	304,300	1,323.000	402,588,900
中国電力	127,100	704.000	89,478,400
北陸電力	76,400	571.000	43,624,400
東北電力	194,000	683.000	132,502,000
四国電力	67,900	752.000	51,060,800
九州電力	181,000	754.000	136,474,000
北海道電力	77,700	485.000	37,684,500
沖縄電力	20,000	1,070.000	21,400,000
電源開発	59,700	2,154.000	128,593,800
イーレックス	14,100	2,032.000	28,651,200
レノバ	21,100	2,251.000	47,496,100
東京瓦斯	166,900	2,681.000	447,458,900
大阪瓦斯	159,700	2,147.000	342,875,900
東邦瓦斯	31,300	2,510.000	78,563,000
北海道瓦斯	5,100	1,808.000	9,220,800
広島ガス	18,900	346.000	6,539,400
西部ガスホールディングス	7,300	1,773.000	12,942,900
静岡ガス	18,000	1,122.000	20,196,000
メタウォーター	9,800	1,645.000	16,121,000
S B Sホールディングス	7,300	3,235.000	23,615,500
東武鉄道	87,500	3,005.000	262,937,500
相鉄ホールディングス	26,300	2,293.000	60,305,900
東急	222,500	1,631.000	362,897,500
京浜急行電鉄	89,900	1,272.000	114,352,800
小田急電鉄	121,000	1,639.000	198,319,000
京王電鉄	41,800	4,700.000	196,460,000
京成電鉄	51,500	3,870.000	199,305,000
富士急行	9,900	4,185.000	41,431,500
東日本旅客鉄道	134,100	6,905.000	925,960,500
西日本旅客鉄道	101,200	5,280.000	534,336,000
東海旅客鉄道	60,900	15,300.000	931,770,000
西武ホールディングス	95,900	1,412.000	135,410,800
鴻池運輸	14,100	1,473.000	20,769,300
西日本鉄道	21,500	2,408.000	51,772,000
ハマキョウレックス	6,500	3,150.000	20,475,000

サカイ引越センター	3,900	4,400.000	17,160,000
近鉄グループホールディングス	79,500	4,115.000	327,142,500
阪急阪神ホールディングス	105,500	3,840.000	405,120,000
南海電気鉄道	38,000	2,753.000	104,614,000
京阪ホールディングス	32,800	3,400.000	111,520,000
神戸電鉄	2,800	3,175.000	8,890,000
名古屋鉄道	87,800	2,077.000	182,360,600
山陽電気鉄道	6,700	2,188.000	14,659,600
アルプス物流	6,100	1,283.000	7,826,300
ヤマトホールディングス	102,000	2,331.000	237,762,000
山九	20,200	4,840.000	97,768,000
丸全昭和運輸	5,200	3,030.000	15,756,000
センコーグループホールディングス	42,500	976.000	41,480,000
トナミホールディングス	1,900	3,840.000	7,296,000
ニッコンホールディングス	26,000	2,470.000	64,220,000
福山通運	6,300	3,360.000	21,168,000
セイノーホールディングス	50,500	1,384.000	69,892,000
神奈川中央交通	2,600	3,270.000	8,502,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	19,700	1,842.000	36,287,400
C & F ロジホールディングス	8,000	1,205.000	9,640,000
九州旅客鉄道	55,900	2,949.000	164,849,100
S Gホールディングス	152,000	2,095.000	318,440,000
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	29,500	7,660.000	225,970,000
日本郵船	210,100	3,329.000	699,422,900
商船三井	138,300	3,420.000	472,986,000
川崎汽船	67,100	3,250.000	218,075,000
N S ユナイテッド海運	4,400	4,165.000	18,326,000
明治海運	9,700	652.000	6,324,400
飯野海運	30,000	1,002.000	30,060,000
乾汽船	10,800	2,038.000	22,010,400
日本航空	193,500	2,601.000	503,293,500
A N Aホールディングス	215,700	2,813.000	606,764,100
パスコ	1,700	1,412.000	2,400,400
トランコム	2,400	6,930.000	16,632,000
日新	6,500	2,030.000	13,195,000
三菱倉庫	17,000	3,115.000	52,955,000
三井倉庫ホールディングス	7,400	4,030.000	29,822,000
住友倉庫	21,500	2,107.000	45,300,500
澁澤倉庫	3,500	2,166.000	7,581,000
東陽倉庫	20,300	273.000	5,541,900
日本トランスシティ	16,400	567.000	9,298,800
川西倉庫	6,300	1,004.000	6,325,200
上組	37,700	2,695.000	101,601,500
キューソー流通システム	7,800	954.000	7,441,200
エーアイティー	5,700	1,578.000	8,994,600
内外トランスライン	3,300	2,165.000	7,144,500
日本コンセプト	3,100	1,347.000	4,175,700

NEC ネットエスアイ	26,400	1,629.000	43,005,600
クロスキャット	5,000	1,273.000	6,365,000
システナ	132,200	345.000	45,609,000
デジタルアーツ	5,100	5,430.000	27,693,000
日鉄ソリューションズ	13,300	3,360.000	44,688,000
キューブシステム	5,600	1,117.000	6,255,200
コア	3,700	1,523.000	5,635,100
手間いらず	1,400	4,965.000	6,951,000
ラクーンホールディングス	7,500	1,128.000	8,460,000
ソリトンシステムズ	4,800	1,013.000	4,862,400
ソフトクリエイティブホールディングス	3,500	3,530.000	12,355,000
T I S	88,700	3,435.000	304,684,500
グリー	22,700	737.000	16,729,900
コーエーテクモホールディングス	49,600	2,370.000	117,552,000
三菱総合研究所	3,900	5,180.000	20,202,000
ファインデックス	8,400	607.000	5,098,800
ブレインパッド	6,600	654.000	4,316,400
K L a b	18,300	394.000	7,210,200
ポルトゥウィンホールディングス	14,300	851.000	12,169,300
ネクソン	204,900	3,070.000	629,043,000
アイスタイル	24,400	445.000	10,858,000
エムアップホールディングス	10,000	1,097.000	10,970,000
エイチーム	7,200	789.000	5,680,800
エニグモ	11,300	613.000	6,926,900
コロブラ	31,000	597.000	18,507,000
ブロードリーフ	48,100	439.000	21,115,900
クロス・マーケティンググループ	5,400	639.000	3,450,600
デジタルハーツホールディングス	5,400	1,535.000	8,289,000
システム情報	7,600	804.000	6,110,400
メディアドゥ	3,700	1,524.000	5,638,800
じげん	25,200	412.000	10,382,400
ブイキューブ	10,800	643.000	6,944,400
フィックスターズ	9,700	1,392.000	13,502,400
C A R T A H O L D I N G S	4,200	1,452.000	6,098,400
オブティム	7,000	976.000	6,832,000
セレス	3,900	1,108.000	4,321,200
S H I F T	5,800	22,550.000	130,790,000
ティーガイア	8,700	1,650.000	14,355,000
テクマトリックス	14,700	1,511.000	22,211,700
プロシップ	4,000	1,404.000	5,616,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	24,600	2,328.000	57,268,800
G M O ペイメントゲートウェイ	18,100	11,370.000	205,797,000
システムリサーチ	2,600	2,207.000	5,738,200
インターネットイニシアティブ	44,000	2,677.000	117,788,000
さくらインターネット	11,100	585.000	6,493,500
ヴィンクス	3,000	1,382.000	4,146,000
G M O グローバルサイン・ホールディングス	2,600	3,965.000	10,309,000
S R A ホールディングス	4,300	3,025.000	13,007,500

朝日ネット	9,400	586.000	5,508,400
e B A S E	12,300	662.000	8,142,600
アバントグループ	10,100	1,353.000	13,665,300
アドソル日進	3,900	1,459.000	5,690,100
フリービット	4,900	1,135.000	5,561,500
コムチュア	10,700	2,224.000	23,796,800
アステリア	7,200	735.000	5,292,000
アイル	4,500	1,912.000	8,604,000
マークラインズ	4,600	2,641.000	12,148,600
メディカル・データ・ビジョン	12,800	902.000	11,545,600
g u m i	13,000	862.000	11,206,000
テラスカイ	3,900	1,955.000	7,624,500
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,900	1,640.000	8,036,000
P R T I M E S	2,300	1,835.000	4,220,500
ラクス	37,500	1,736.000	65,100,000
ダブルスタンダード	3,600	2,015.000	7,254,000
オープンドア	6,000	1,607.000	9,642,000
アカツキ	4,200	2,160.000	9,072,000
U B I C O Mホールディングス	2,800	1,924.000	5,387,200
カナミックネットワーク	13,400	525.000	7,035,000
チェンジ	19,500	2,665.000	51,967,500
オークネット	4,400	1,764.000	7,761,600
マクロミル	16,300	1,027.000	16,740,100
オロ	2,800	1,756.000	4,916,800
ユーザーローカル	3,400	1,691.000	5,749,400
マネーフォワード	19,200	4,840.000	92,928,000
S U N A S T E R I S K	4,600	1,233.000	5,671,800
電算システムホールディングス	4,200	2,507.000	10,529,400
A P P I E R G R O U P	22,800	1,710.000	38,988,000
プロトコーポレーション	10,100	1,246.000	12,584,600
野村総合研究所	162,500	2,952.000	479,700,000
サイバネットシステム	8,500	980.000	8,330,000
日本システム技術	3,400	1,715.000	5,831,000
インテージホールディングス	9,300	1,680.000	15,624,000
ソースネクスト	43,400	234.000	10,155,600
インフォコム	10,100	2,361.000	23,846,100
シンプレクス・ホールディングス	13,500	2,360.000	31,860,000
H E R O Z	3,500	1,071.000	3,748,500
ラクスル	22,600	1,354.000	30,600,400
メルカリ	36,000	2,544.000	91,584,000
I P S	2,800	2,625.000	7,350,000
F I G	11,800	305.000	3,599,000
システムサポート	3,500	1,751.000	6,128,500
イーソル	5,900	723.000	4,265,700
アルテリア・ネットワークス	8,200	1,288.000	10,561,600
ウイングアーク1 s t	8,500	1,819.000	15,461,500
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,500	1,568.000	3,920,000

サーバーワークス	1,900	2,322.000	4,411,800
Sansan	26,300	1,520.000	39,976,000
ギフト	8,900	2,566.000	22,837,400
メドレー	8,000	4,335.000	34,680,000
ベース	2,700	4,720.000	12,744,000
JMDC	13,100	4,280.000	56,068,000
フォーカスシステムズ	6,700	1,007.000	6,746,900
クレスコ	6,400	1,743.000	11,155,200
フジ・メディア・ホールディングス	76,200	1,112.000	84,734,400
オービック	26,400	20,070.000	529,848,000
ジャストシステム	11,500	3,445.000	39,617,500
TDCソフト	6,900	1,509.000	10,412,100
Zホールディングス	1,129,300	383.000	432,521,900
トレンドマイクロ	45,900	6,500.000	298,350,000
日本オラクル	15,300	9,350.000	143,055,000
アルファシステムズ	2,600	4,235.000	11,011,000
フューチャー	19,700	1,783.000	35,125,100
CAC HOLDINGS	5,100	1,612.000	8,221,200
SBテクノロジー	3,800	1,972.000	7,493,600
オービックビジネスコンサルタント	15,600	4,765.000	74,334,000
伊藤忠テクノソリューションズ	42,500	3,060.000	130,050,000
アイティフォー	10,900	865.000	9,428,500
東計電算	1,500	5,940.000	8,910,000
大塚商会	45,000	4,585.000	206,325,000
サイボウズ	11,100	2,625.000	29,137,500
電通国際情報サービス	9,500	4,890.000	46,455,000
ACCESS	10,400	990.000	10,296,000
デジタルガレージ	14,100	4,545.000	64,084,500
イーエムシステムズ	14,100	869.000	12,252,900
ウェザーニューズ	2,500	6,780.000	16,950,000
CIJ	7,300	1,033.000	7,540,900
ビジネスエンジニアリング	1,800	2,725.000	4,905,000
WOWOW	5,800	1,251.000	7,255,800
スカラ	8,900	725.000	6,452,500
IMAGICA GROUP	8,200	669.000	5,485,800
ネットワンシステムズ	29,700	3,285.000	97,564,500
アルゴグラフィックス	7,200	3,825.000	27,540,000
マーベラス	14,000	720.000	10,080,000
エイベックス	13,900	1,613.000	22,420,700
BIPROGY	29,200	2,921.000	85,293,200
兼松エレクトロニクス	5,000	6,180.000	30,900,000
都築電気	4,700	1,354.000	6,363,800
TBSホールディングス	40,700	1,629.000	66,300,300
日本テレビホールディングス	70,400	1,080.000	76,032,000
朝日放送グループホールディングス	10,200	660.000	6,732,000
テレビ朝日ホールディングス	18,800	1,402.000	26,357,600
スカパーJ SATホールディングス	71,300	487.000	34,723,100
テレビ東京ホールディングス	6,300	2,128.000	13,406,400

日本BS放送	7,200	910.000	6,552,000
ビジョン	10,800	1,599.000	17,269,200
USEN-NEXT HOLDINGS	7,300	2,615.000	19,089,500
日本通信	77,300	240.000	18,552,000
日本電信電話	1,014,900	3,972.000	4,031,182,800
KDDI	612,100	4,039.000	2,472,271,900
ソフトバンク	1,272,400	1,532.500	1,949,953,000
光通信	9,300	20,230.000	188,139,000
エムティーアイ	9,700	510.000	4,947,000
GMOインターネットグループ	29,500	2,573.000	75,903,500
ファイバーゲート	5,300	889.000	4,711,700
KADOKAWA	41,900	2,733.000	114,512,700
学研ホールディングス	14,200	863.000	12,254,600
ゼンリン	14,300	852.000	12,183,600
アイネット	5,700	1,280.000	7,296,000
松竹	4,600	11,050.000	50,830,000
東宝	49,500	4,730.000	234,135,000
東映	2,200	17,110.000	37,642,000
エヌ・ティ・ティ・データ	247,900	1,883.000	466,795,700
ピー・シー・エー	5,000	1,239.000	6,195,000
ビジネスブレイン太田昭和	3,800	2,095.000	7,961,000
DTS	16,500	3,095.000	51,067,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	39,900	6,240.000	248,976,000
シーイーシー	11,500	1,506.000	17,319,000
カプコン	78,600	4,490.000	352,914,000
アイ・エス・ピー	4,500	1,202.000	5,409,000
ジャステック	5,500	1,238.000	6,809,000
SCSK	64,200	1,952.000	125,318,400
NSW	3,300	2,104.000	6,943,200
アイネス	6,300	1,331.000	8,385,300
TKC	13,800	3,645.000	50,301,000
富士ソフト	8,900	7,710.000	68,619,000
NSD	27,700	2,292.000	63,488,400
コナミグループ	34,000	6,260.000	212,840,000
福井コンピュータホールディングス	5,600	2,820.000	15,792,000
JBCCHホールディングス	6,000	1,892.000	11,352,000
ミロク情報サービス	7,900	1,809.000	14,291,100
ソフトバンクグループ	458,100	5,729.000	2,624,454,900
高千穂交易	3,100	2,407.000	7,461,700
伊藤忠食品	2,000	4,970.000	9,940,000
エレマテック	7,800	1,734.000	13,525,200
あらた	6,600	4,035.000	26,631,000
トーメンデバイス	1,300	6,770.000	8,801,000
東京エレクトロン デバイス	3,100	7,930.000	24,583,000
円谷フィールズホールディングス	7,500	4,045.000	30,337,500
双日	88,600	2,576.000	228,233,600
アルフレッサ ホールディングス	84,500	1,641.000	138,664,500
横浜冷凍	24,400	997.000	24,326,800



ラサ商事	6,900	1,386.000	9,563,400
アルコニックス	11,800	1,346.000	15,882,800
神戸物産	64,700	3,610.000	233,567,000
あい ホールディングス	13,400	2,133.000	28,582,200
ダイワボウホールディングス	34,100	2,064.000	70,382,400
マクニカホールディングス	20,400	3,540.000	72,216,000
ラクト・ジャパン	3,800	1,992.000	7,569,600
グリムス	3,600	2,481.000	8,931,600
バイタルケーエスケー・ホールディングス	13,900	866.000	12,037,400
八洲電機	8,000	1,119.000	8,952,000
メディアスホールディングス	7,000	759.000	5,313,000
レスターホールディングス	8,000	2,215.000	17,720,000
ジュテックホールディングス	3,500	1,240.000	4,340,000
T O K A Iホールディングス	41,900	862.000	36,117,800
三洋貿易	9,300	1,139.000	10,592,700
ビューティガレージ	1,600	3,825.000	6,120,000
ウイン・パートナーズ	6,600	1,057.000	6,976,200
ミタチ産業	3,600	1,288.000	4,636,800
シップヘルスケアホールディングス	30,300	2,494.000	75,568,200
コメダホールディングス	21,200	2,360.000	50,032,000
フルサト・マルカホールディングス	8,400	2,955.000	24,822,000
ヤマエグループホールディングス	5,700	1,653.000	9,422,100
小野建	8,400	1,506.000	12,650,400
佐鳥電機	5,500	1,633.000	8,981,500
伯東	4,900	4,840.000	23,716,000
コンドーテック	7,600	1,060.000	8,056,000
ナガイレーベン	11,000	1,971.000	21,681,000
三菱食品	8,600	3,290.000	28,294,000
松田産業	6,500	2,270.000	14,755,000
第一興商	16,300	4,250.000	69,275,000
メディパルホールディングス	87,100	1,750.000	152,425,000
S P K	4,900	1,519.000	7,443,100
萩原電気ホールディングス	3,700	2,666.000	9,864,200
アズワン	12,300	5,710.000	70,233,000
スズデン	3,900	2,663.000	10,385,700
尾家産業	5,600	1,019.000	5,706,400
シモジマ	7,300	1,023.000	7,467,900
ドウシシャ	8,800	1,769.000	15,567,200
高速	4,600	1,922.000	8,841,200
リックス	2,300	2,511.000	5,775,300
丸文	8,600	1,323.000	11,377,800
ハピネット	7,700	1,858.000	14,306,600
日本ライフライン	25,500	914.000	23,307,000
タカショー	9,700	686.000	6,654,200
I D O M	26,200	870.000	22,794,000
進和	6,100	2,126.000	12,968,600
ダイترون	3,600	2,457.000	8,845,200
シークス	12,100	1,504.000	18,198,400

オーハシテクニカ	5,100	1,545.000	7,879,500
白銅	3,300	2,588.000	8,540,400
伊藤忠商事	514,500	4,108.000	2,113,566,000
丸紅	659,400	1,758.500	1,159,554,900
高島	900	2,955.000	2,659,500
長瀬産業	38,800	2,044.000	79,307,200
蝶理	4,600	2,509.000	11,541,400
豊田通商	72,900	5,580.000	406,782,000
三共生興	17,000	553.000	9,401,000
兼松	32,100	1,591.000	51,071,100
三井物産	611,300	3,908.000	2,388,960,400
日本紙パルプ商事	4,500	5,150.000	23,175,000
カメイ	9,400	1,376.000	12,934,400
スターゼン	6,900	2,148.000	14,821,200
山善	22,400	1,044.000	23,385,600
椿本興業	1,600	4,090.000	6,544,000
住友商事	517,500	2,361.500	1,222,076,250
内田洋行	3,800	4,700.000	17,860,000
三菱商事	522,400	4,675.000	2,442,220,000
第一実業	3,200	5,200.000	16,640,000
キヤノンマーケティングジャパン	19,500	3,090.000	60,255,000
西華産業	4,300	1,720.000	7,396,000
佐藤商事	6,300	1,367.000	8,612,100
菱洋エレクトロ	7,800	2,436.000	19,000,800
東京産業	8,900	773.000	6,879,700
ユアサ商事	7,500	3,635.000	27,262,500
神鋼商事	2,200	5,820.000	12,804,000
阪和興業	15,000	3,970.000	59,550,000
正栄食品工業	5,800	4,165.000	24,157,000
カナデン	8,000	1,103.000	8,824,000
菱電商事	7,100	1,866.000	13,248,600
岩谷産業	19,100	5,660.000	108,106,000
ナイス	3,300	1,368.000	4,514,400
極東貿易	6,100	1,446.000	8,820,600
アステナホールディングス	18,200	426.000	7,753,200
三愛オブリ	23,400	1,402.000	32,806,800
稲畑産業	16,900	2,610.000	44,109,000
G S Iクレオス	5,700	1,562.000	8,903,400
明和産業	12,300	702.000	8,634,600
ワキタ	16,200	1,167.000	18,905,400
東邦ホールディングス	21,600	2,151.000	46,461,600
サンゲツ	21,400	2,383.000	50,996,200
ミツウロコグループホールディングス	12,000	1,350.000	16,200,000
シナネンホールディングス	3,000	3,515.000	10,545,000
伊藤忠エネクス	20,600	1,102.000	22,701,200
サンリオ	23,800	4,080.000	97,104,000
サンワ テクノス	4,800	1,929.000	9,259,200
リョーサン	9,100	3,075.000	27,982,500

新光商事	12,000	1,288.000	15,456,000
トーホー	4,500	1,765.000	7,942,500
三信電気	3,800	2,550.000	9,690,000
東陽テクニカ	9,700	1,299.000	12,600,300
モスフードサービス	12,600	3,080.000	38,808,000
加賀電子	6,800	4,670.000	31,756,000
ソーダニッカ	7,900	767.000	6,059,300
立花エレテック	6,500	1,873.000	12,174,500
PALTA C	13,300	4,860.000	64,638,000
三谷産業	20,100	319.000	6,411,900
太平洋興発	6,400	1,036.000	6,630,400
西本Wismettacホールディングス	2,400	3,625.000	8,700,000
コア商事ホールディングス	6,000	637.000	3,822,000
KPPグループホールディングス	20,200	787.000	15,897,400
ヤマタネ	5,000	1,665.000	8,325,000
泉州電業	4,400	3,655.000	16,082,000
トラスコ中山	17,700	2,202.000	38,975,400
オートバックスセブン	29,900	1,448.000	43,295,200
モリト	7,100	985.000	6,993,500
加藤産業	10,100	3,635.000	36,713,500
イエローハット	14,900	1,778.000	26,492,200
JKホールディングス	7,300	1,062.000	7,752,600
日伝	5,400	1,903.000	10,276,200
杉本商事	4,000	1,916.000	7,664,000
因幡電機産業	21,200	2,804.000	59,444,800
東テク	3,000	4,155.000	12,465,000
ミスミグループ本社	126,100	3,115.000	392,801,500
アルテック	7,100	272.000	1,931,200
タキヒヨー	5,400	963.000	5,200,200
スズケン	26,300	3,485.000	91,655,500
ジェコス	6,700	879.000	5,889,300
グローセル	14,600	414.000	6,044,400
ローソン	20,900	5,420.000	113,278,000
サンエー	6,400	4,160.000	26,624,000
カワチ薬品	6,700	2,323.000	15,564,100
エービーシー・マート	12,200	6,780.000	82,716,000
ハードオフコーポレーション	4,100	1,300.000	5,330,000
アスクル	17,600	1,733.000	30,500,800
ゲオホールディングス	9,300	1,767.000	16,433,100
アダストリア	10,300	2,273.000	23,411,900
くら寿司	10,000	3,180.000	31,800,000
キャンドゥ	4,300	2,313.000	9,945,900
パルグループホールディングス	8,400	2,761.000	23,192,400
エディオン	32,700	1,319.000	43,131,300
サーラコーポレーション	18,900	712.000	13,456,800
ハローズ	3,900	3,365.000	13,123,500
フジオフードグループ本社	7,600	1,356.000	10,305,600
ひらまつ	6,400	191.000	1,222,400

大黒天物産	2,700	4,930.000	13,311,000
ハニーズホールディングス	7,100	1,453.000	10,316,300
アルペン	7,200	1,950.000	14,040,000
クオールホールディングス	12,200	1,190.000	14,518,000
ジーンズホールディングス	5,200	3,520.000	18,304,000
ビックカメラ	55,900	1,181.000	66,017,900
D C Mホールディングス	51,400	1,193.000	61,320,200
Monotaro	118,500	1,908.000	226,098,000
アークランドサービスホールディングス	6,800	2,187.000	14,871,600
J . フロント リテイリング	104,600	1,284.000	134,306,400
ドトール・日レスホールディングス	14,800	1,879.000	27,809,200
マツキヨココカラ&カンパニー	50,700	6,620.000	335,634,000
ブロンコビリー	4,600	2,411.000	11,090,600
Z O Z O	55,400	3,075.000	170,355,000
トレジャー・ファクトリー	2,600	2,414.000	6,276,400
物語コーポレーション	4,700	7,130.000	33,511,000
三越伊勢丹ホールディングス	141,000	1,411.000	198,951,000
ウエルシアホールディングス	43,500	3,025.000	131,587,500
クリエイティブSDホールディングス	13,600	3,380.000	45,968,000
チムニー	6,500	1,158.000	7,527,000
シュッピン	6,900	906.000	6,251,400
オイシックス・ラ・大地	11,400	2,512.000	28,636,800
ネクステージ	19,200	3,175.000	60,960,000
ジョイフル本田	24,700	1,766.000	43,620,200
鳥貴族ホールディングス	3,800	2,049.000	7,786,200
ホットランド	7,000	1,379.000	9,653,000
すかいらーくホールディングス	114,500	1,599.000	183,085,500
S F Pホールディングス	5,100	1,768.000	9,016,800
綿半ホールディングス	7,000	1,416.000	9,912,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	29,200	1,122.000	32,762,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,300	977.000	4,201,100
B E E N O S	5,100	2,503.000	12,765,300
あさひ	7,100	1,363.000	9,677,300
日本調剤	6,500	1,173.000	7,624,500
コスモス薬品	8,300	12,630.000	104,829,000
セブン&アイ・ホールディングス	288,000	6,134.000	1,766,592,000
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	63,400	960.000	60,864,000
ツルハホールディングス	17,600	9,490.000	167,024,000
サンマルクホールディングス	7,200	1,788.000	12,873,600
フェリシモ	4,600	1,000.000	4,600,000
トリドールホールディングス	20,900	2,696.000	56,346,400
T O K Y O B A S E	10,200	457.000	4,661,400
J Mホールディングス	7,500	1,872.000	14,040,000
アレンザホールディングス	7,100	1,015.000	7,206,500
串カツ田中ホールディングス	3,500	1,603.000	5,610,500
クスリのアオキホールディングス	7,600	7,100.000	53,960,000
力の源ホールディングス	5,400	1,392.000	7,516,800

FOOD & LIFE COMPANIES	48,100	3,500.000	168,350,000
ノジマ	27,300	1,309.000	35,735,700
カップ・クリエイト	13,500	1,429.000	19,291,500
ライトオン	5,000	558.000	2,790,000
良品計画	108,100	1,404.000	151,772,400
アドヴァングループ	10,400	905.000	9,412,000
アルビス	3,100	2,402.000	7,446,200
G - 7ホールディングス	10,400	1,436.000	14,934,400
イオン北海道	13,800	891.000	12,295,800
コジマ	17,000	559.000	9,503,000
コーナン商事	11,300	3,360.000	37,968,000
エコス	3,500	1,854.000	6,489,000
ワタミ	10,800	900.000	9,720,000
パン・パシフィック・インターナショナルホ ールディングス	168,800	2,584.000	436,179,200
西松屋チェーン	18,900	1,565.000	29,578,500
ゼンショーホールディングス	45,600	3,810.000	173,736,000
幸楽苑ホールディングス	6,800	1,051.000	7,146,800
サイゼリヤ	14,200	3,055.000	43,381,000
V Tホールディングス	31,300	503.000	15,743,900
フジ・コーポレーション	5,000	1,251.000	6,255,000
ユナイテッドアローズ	9,300	1,741.000	16,191,300
ハイデイ日高	12,400	2,057.000	25,506,800
コロワイド	39,000	1,875.000	73,125,000
壱番屋	6,400	4,690.000	30,016,000
スギホールディングス	16,900	5,730.000	96,837,000
薬王堂ホールディングス	5,100	2,422.000	12,352,200
スクロール	13,400	785.000	10,519,000
ヨンドシーホールディングス	7,700	1,795.000	13,821,500
木曽路	12,900	2,191.000	28,263,900
S R Sホールディングス	15,700	914.000	14,349,800
千趣会	18,000	396.000	7,128,000
リテールパートナーズ	12,600	1,307.000	16,468,200
ケーヨー	14,500	896.000	12,992,000
上新電機	7,200	1,991.000	14,335,200
日本瓦斯	45,200	1,879.000	84,930,800
ロイヤルホールディングス	16,500	2,560.000	42,240,000
いなげや	8,500	1,339.000	11,381,500
チヨダ	10,800	792.000	8,553,600
ライフコーポレーション	7,500	2,796.000	20,970,000
リンガーハット	11,300	2,251.000	25,436,300
Mr M a x H D	13,000	684.000	8,892,000
A O K Iホールディングス	16,900	785.000	13,266,500
オークワ	14,400	921.000	13,262,400
コメリ	12,800	2,650.000	33,920,000
青山商事	19,200	951.000	18,259,200
しまむら	9,800	12,930.000	126,714,000
高島屋	63,600	1,904.000	121,094,400

松屋	14,900	1,138.000	16,956,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	41,200	1,359.000	55,990,800
近鉄百貨店	3,800	2,454.000	9,325,200
丸井グループ	61,600	2,066.000	127,265,600
アクシアル リテイリング	5,700	3,545.000	20,206,500
イオン	283,300	2,613.500	740,404,550
イズミ	12,900	2,995.000	38,635,500
平和堂	13,700	2,177.000	29,824,900
フジ	13,100	1,827.000	23,933,700
ヤオコー	9,400	6,840.000	64,296,000
ゼビオホールディングス	11,900	979.000	11,650,100
ケーズホールディングス	66,800	1,182.000	78,957,600
OLYMPICグループ	4,600	535.000	2,461,000
シルバーライフ	2,300	1,830.000	4,209,000
Genky DrugStores	3,800	4,245.000	16,131,000
ブックオフグループホールディングス	5,600	1,274.000	7,134,400
ギフトホールディングス	1,900	4,285.000	8,141,500
アインホールディングス	11,700	5,600.000	65,520,000
元気寿司	3,100	3,045.000	9,439,500
ヤマダホールディングス	343,200	479.000	164,392,800
アークランズ	12,800	1,455.000	18,624,000
ニトリホールディングス	33,800	16,085.000	543,673,000
グルメ杵屋	8,400	1,011.000	8,492,400
ケーユーホールディングス	5,800	1,455.000	8,439,000
吉野家ホールディングス	32,900	2,371.000	78,005,900
松屋フーズホールディングス	3,800	4,000.000	15,200,000
サガミホールディングス	14,100	1,273.000	17,949,300
関西フードマーケット	8,700	1,357.000	11,805,900
王将フードサービス	5,300	6,070.000	32,171,000
ミニストップ	6,900	1,412.000	9,742,800
アークス	14,900	2,218.000	33,048,200
パローホールディングス	15,600	1,930.000	30,108,000
ベルク	4,200	5,530.000	23,226,000
大 庄	7,300	1,038.000	7,577,400
ファーストリテイリング	12,500	82,670.000	1,033,375,000
サンドラッグ	31,900	3,710.000	118,349,000
サックスパー ホールディングス	9,600	774.000	7,430,400
やまや	3,000	2,613.000	7,839,000
ペルーナ	20,500	685.000	14,042,500
いよぎんホールディングス	92,600	811.000	75,098,600
しずおかフィナンシャルグループ	175,400	1,109.000	194,518,600
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	64,800	966.000	62,596,800
じもとホールディングス	11,100	434.000	4,817,400
めぶきフィナンシャルグループ	384,100	369.000	141,732,900
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10,100	3,010.000	30,401,000
九州フィナンシャルグループ	135,000	511.000	68,985,000
ゆうちょ銀行	221,400	1,208.000	267,451,200
富山第一銀行	20,600	654.000	13,472,400

コンコルディア・フィナンシャルグループ	428,300	572.000	244,987,600
西日本フィナンシャルホールディングス	49,100	1,129.000	55,433,900
三十三フィナンシャルグループ	7,500	1,717.000	12,877,500
第四北越フィナンシャルグループ	11,700	3,225.000	37,732,500
ひろぎんホールディングス	100,300	693.000	69,507,900
おきなわフィナンシャルグループ	7,700	2,345.000	18,056,500
十六フィナンシャルグループ	9,800	3,190.000	31,262,000
北國フィナンシャルホールディングス	6,800	4,330.000	29,444,000
プロクレアホールディングス	9,800	2,339.000	22,922,200
あいちフィナンシャルグループ	10,900	2,344.000	25,549,600
S B I 新生銀行	23,600	2,436.000	57,489,600
あおぞら銀行	48,400	2,651.000	128,308,400
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,936,700	998.300	4,928,307,610
りそなホールディングス	991,600	753.900	747,567,240
三井住友トラスト・ホールディングス	140,900	4,961.000	699,004,900
三井住友フィナンシャルグループ	568,000	6,000.000	3,408,000,000
千葉銀行	215,800	990.000	213,642,000
群馬銀行	149,500	507.000	75,796,500
武蔵野銀行	9,600	2,497.000	23,971,200
千葉興業銀行	17,800	513.000	9,131,400
筑波銀行	37,700	239.000	9,010,300
七十七銀行	24,800	2,413.000	59,842,400
秋田銀行	5,700	1,940.000	11,058,000
山形銀行	9,400	1,277.000	12,003,800
岩手銀行	5,700	2,437.000	13,890,900
東邦銀行	64,600	248.000	16,020,800
東北銀行	6,800	1,032.000	7,017,600
ふくおかフィナンシャルグループ	61,900	3,095.000	191,580,500
スルガ銀行	69,500	423.000	29,398,500
八十二銀行	143,200	604.000	86,492,800
山梨中央銀行	9,100	1,353.000	12,312,300
大垣共立銀行	14,300	1,998.000	28,571,400
福井銀行	7,500	1,694.000	12,705,000
清水銀行	3,600	1,546.000	5,565,600
富山銀行	900	1,805.000	1,624,500
滋賀銀行	12,900	2,908.000	37,513,200
南都銀行	11,500	2,673.000	30,739,500
百五銀行	71,900	417.000	29,982,300
京都銀行	24,500	6,430.000	157,535,000
紀陽銀行	27,300	1,621.000	44,253,300
ほくほくフィナンシャルグループ	49,200	1,056.000	51,955,200
山陰合同銀行	48,000	843.000	40,464,000
鳥取銀行	5,700	1,277.000	7,278,900
百十四銀行	7,500	1,997.000	14,977,500
四国銀行	13,100	952.000	12,471,200
阿波銀行	11,300	2,236.000	25,266,800
大分銀行	5,200	2,260.000	11,752,000
宮崎銀行	5,100	2,783.000	14,193,300

佐賀銀行	4,800	1,846.000	8,860,800
琉球銀行	18,600	1,099.000	20,441,400
セブン銀行	278,500	269.000	74,916,500
みずほフィナンシャルグループ	1,123,900	2,145.000	2,410,765,500
山口フィナンシャルグループ	85,500	922.000	78,831,000
長野銀行	8,700	1,524.000	13,258,800
名古屋銀行	5,100	3,620.000	18,462,000
北洋銀行	118,000	299.000	35,282,000
大光銀行	2,500	1,256.000	3,140,000
愛媛銀行	11,400	959.000	10,932,600
京葉銀行	37,100	651.000	24,152,100
栃木銀行	38,600	331.000	12,776,600
北日本銀行	3,200	2,143.000	6,857,600
東和銀行	15,600	608.000	9,484,800
トモニホールディングス	63,500	390.000	24,765,000
フィデアホールディングス	8,500	1,477.000	12,554,500
池田泉州ホールディングス	102,400	255.000	26,112,000
F P G	32,200	1,217.000	39,187,400
ジャパンインベストメントアドバイザー	6,900	1,055.000	7,279,500
S B Iホールディングス	112,200	2,960.000	332,112,000
ジャフコ グループ	26,400	2,121.000	55,994,400
大和証券グループ本社	552,400	644.000	355,745,600
野村ホールディングス	1,429,100	565.800	808,584,780
岡三証券グループ	69,000	447.000	30,843,000
丸三証券	29,400	440.000	12,936,000
東洋証券	30,000	326.000	9,780,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	83,400	389.000	32,442,600
水戸証券	23,100	303.000	6,999,300
いちよし証券	16,000	651.000	10,416,000
松井証券	46,200	805.000	37,191,000
マネックスグループ	87,200	529.000	46,128,800
極東証券	13,100	626.000	8,200,600
岩井コスモホールディングス	9,400	1,383.000	13,000,200
アイザワ証券グループ	12,700	710.000	9,017,000
スパークス・グループ	8,900	1,716.000	15,272,400
かんぽ生命保険	94,600	2,411.000	228,080,600
S O M P Oホールディングス	133,400	5,796.000	773,186,400
アニコム ホールディングス	28,600	567.000	16,216,200
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	157,900	4,457.000	703,760,300
第一生命ホールディングス	396,000	2,964.000	1,173,744,000
東京海上ホールディングス	782,800	2,866.500	2,243,896,200
T & Dホールディングス	208,900	2,165.000	452,268,500
アドバンスクリエイト	6,200	1,187.000	7,359,400
全国保証	20,500	5,290.000	108,445,000
ジェイリース	2,600	2,380.000	6,188,000
日本モーゲージサービス	7,100	881.000	6,255,100
アルヒ	11,200	1,119.000	12,532,800



プレミアグループ	13,300	1,556.000	20,694,800
ネットプロテクションズホールディングス	18,600	578.000	10,750,800
クレディセゾン	49,800	1,824.000	90,835,200
芙蓉総合リース	7,100	9,090.000	64,539,000
みずほリース	11,300	3,585.000	40,510,500
東京センチュリー	14,500	4,630.000	67,135,000
日本証券金融	31,800	1,033.000	32,849,400
アイフル	131,200	369.000	48,412,800
リコーリース	7,500	3,955.000	29,662,500
イオンフィナンシャルサービス	44,800	1,332.000	59,673,600
アコム	148,000	327.000	48,396,000
ジャックス	8,300	4,290.000	35,607,000
オリエントコーポレーション	20,800	1,166.000	24,252,800
オリックス	519,600	2,426.500	1,260,809,400
三菱HCキャピタル	300,400	695.000	208,778,000
九州リースサービス	7,600	913.000	6,938,800
日本取引所グループ	218,800	1,966.500	430,270,200
イー・ギャランティ	13,100	2,275.000	29,802,500
NECキャピタルソリューション	4,200	2,580.000	10,836,000
大東建託	28,600	12,580.000	359,788,000
いちご	93,500	288.000	26,928,000
日本駐車場開発	97,200	256.000	24,883,200
スター・マイカ・ホールディングス	8,900	663.000	5,900,700
SREホールディングス	4,500	3,470.000	15,615,000
ヒューリック	182,500	1,083.000	197,647,500
三栄建築設計	4,900	1,493.000	7,315,700
野村不動産ホールディングス	49,000	2,921.000	143,129,000
三重交通グループホールディングス	19,900	499.000	9,930,100
サムティ	10,100	2,046.000	20,664,600
ディア・ライフ	14,500	619.000	8,975,500
地主	7,200	1,901.000	13,687,200
プレサンスコーポレーション	11,100	1,677.000	18,614,700
JPMC	5,800	998.000	5,788,400
フージャースホールディングス	13,900	827.000	11,495,300
オープンハウスグループ	29,000	4,840.000	140,360,000
東急不動産ホールディングス	238,000	639.000	152,082,000
飯田グループホールディングス	68,900	2,199.000	151,511,100
イーランド	1,800	1,528.000	2,750,400
シーアールイー	4,700	1,090.000	5,123,000
ケイアイスター不動産	4,200	4,105.000	17,241,000
グッドコムアセット	8,100	844.000	6,836,400
ジェイ・エス・ビー	2,100	3,795.000	7,969,500
ロードスターキャピタル	3,900	1,561.000	6,087,900
パーク24	61,500	2,028.000	124,722,000
パラカ	3,900	1,949.000	7,601,100
宮越ホールディングス	4,400	821.000	3,612,400
三井不動産	338,300	2,485.500	840,844,650
三菱地所	470,000	1,638.000	769,860,000

平和不動産	13,500	3,595.000	48,532,500
東京建物	75,000	1,593.000	119,475,000
京阪神ビルディング	10,600	1,219.000	12,921,400
住友不動産	140,800	3,100.000	436,480,000
テーオーシー	17,700	629.000	11,133,300
東京楽天地	1,800	4,460.000	8,028,000
スターツコーポレーション	12,000	2,562.000	30,744,000
フジ住宅	12,700	676.000	8,585,200
空港施設	12,600	518.000	6,526,800
ゴールドクレスト	8,400	1,658.000	13,927,200
エスリード	4,300	2,097.000	9,017,100
日神グループホールディングス	16,300	451.000	7,351,300
日本エスコン	18,500	828.000	15,318,000
M I R A R T Hホールディングス	42,800	361.000	15,450,800
イオンモール	41,000	1,810.000	74,210,000
カチタス	21,500	2,694.000	57,921,000
トーセイ	14,000	1,442.000	20,188,000
穴吹興産	2,300	2,180.000	5,014,000
サンフロンティア不動産	14,500	1,221.000	17,704,500
F Jネクストホールディングス	9,000	985.000	8,865,000
日本空港ビルディング	28,000	6,500.000	182,000,000
日本工営	5,100	3,240.000	16,524,000
L I F U L L	32,400	194.000	6,285,600
M I X I	18,800	2,631.000	49,462,800
ジェイエイシーリクルートメント	7,400	2,279.000	16,864,600
日本M & Aセンターホールディングス	139,500	1,199.000	167,260,500
メンバーズ	2,700	1,453.000	3,923,100
UTグループ	12,000	2,421.000	29,052,000
アイティメディア	3,500	1,504.000	5,264,000
E・Jホールディングス	5,500	1,352.000	7,436,000
オープンアップグループ	24,400	1,877.000	45,798,800
コシダカホールディングス	25,200	919.000	23,158,800
パソナグループ	10,000	1,924.000	19,240,000
リンクアンドモチベーション	24,600	600.000	14,760,000
エス・エム・エス	31,000	3,330.000	103,230,000
パーソルホールディングス	90,800	2,793.000	253,604,400
リニカル	6,300	711.000	4,479,300
クックパッド	32,100	222.000	7,126,200
学情	4,200	1,384.000	5,812,800
スタジオアリス	4,700	2,100.000	9,870,000
シミツホールディングス	5,200	1,760.000	9,152,000
総合警備保障	30,400	3,510.000	106,704,000
カカクコム	60,900	1,925.000	117,232,500
アイロムグループ	3,400	1,993.000	6,776,200
セントケア・ホールディング	5,800	785.000	4,553,000
ルネサンス	7,100	892.000	6,333,200
ディップ	14,300	3,660.000	52,338,000
デジタルホールディングス	7,000	1,166.000	8,162,000

新日本科学	8,900	2,671.000	23,771,900
ベネフィット・ワン	37,800	2,084.000	78,775,200
エムスリー	160,600	3,305.000	530,783,000
アウトソーシング	48,900	1,259.000	61,565,100
ウェルネット	9,200	661.000	6,081,200
ワールドホールディングス	3,900	2,691.000	10,494,900
ディー・エヌ・エー	35,200	1,797.000	63,254,400
博報堂DYホールディングス	103,600	1,504.000	155,814,400
タカミヤ	14,800	434.000	6,423,200
ジャパンベストレスキューシステム	6,100	789.000	4,812,900
ファンコミュニケーションズ	20,000	410.000	8,200,000
ライク	3,600	1,901.000	6,843,600
エスプール	23,800	690.000	16,422,000
WDBホールディングス	4,500	2,013.000	9,058,500
アドウェイズ	12,600	650.000	8,190,000
バリューコマース	6,200	1,711.000	10,608,200
インフォマート	85,600	328.000	28,076,800
J Pホールディングス	27,100	343.000	9,295,300
プレステージ・インターナショナル	35,200	675.000	23,760,000
アミューズ	5,200	1,765.000	9,178,000
ドリームインキュベータ	2,800	2,808.000	7,862,400
クイック	6,500	1,834.000	11,921,000
電通グループ	79,700	4,360.000	347,492,000
ぴあ	3,100	3,115.000	9,656,500
イオンファンタジー	3,900	2,845.000	11,095,500
シーティーエス	10,400	787.000	8,184,800
H . U . グループホールディングス	24,200	2,687.000	65,025,400
アルプス技研	7,700	2,398.000	18,464,600
日本空調サービス	10,700	721.000	7,714,700
オリエンタルランド	86,000	21,475.000	1,846,850,000
ダスキン	18,200	3,120.000	56,784,000
明光ネットワークジャパン	14,200	621.000	8,818,200
ファルコホールディングス	4,400	1,964.000	8,641,600
ラウンドワン	69,600	480.000	33,408,000
リゾートトラスト	32,400	2,144.000	69,465,600
ビー・エム・エル	10,500	3,165.000	33,232,500
リソー教育	40,300	354.000	14,266,200
早稲田アカデミー	5,900	1,207.000	7,121,300
ユー・エス・エス	83,800	2,232.000	187,041,600
東京個別指導学院	12,400	531.000	6,584,400
サイバーエージェント	194,800	1,200.000	233,760,000
楽天グループ	345,700	691.000	238,878,700
クリーク・アンド・リバー社	5,200	2,268.000	11,793,600
モーニングスター	15,800	489.000	7,726,200
テー・オー・ダブリュー	20,400	306.000	6,242,400
山田コンサルティンググループ	5,300	1,536.000	8,140,800
セントラルスポーツ	3,700	2,466.000	9,124,200
フルキャストホールディングス	7,800	2,500.000	19,500,000

エン・ジャパン	14,900	2,409.000	35,894,100
テクノプロ・ホールディングス	48,000	3,470.000	166,560,000
アイ・アールジャパンホールディングス	4,600	1,989.000	9,149,400
K e e P e r 技研	5,100	3,565.000	18,181,500
G u n o s y	8,100	652.000	5,281,200
イー・ガーディアン	3,500	2,381.000	8,333,500
ジャパンマテリアル	25,000	2,363.000	59,075,000
ベクトル	13,300	1,360.000	18,088,000
チャーム・ケア・コーポレーション	7,400	1,109.000	8,206,600
キャリアリンク	3,100	2,530.000	7,843,000
I B J	6,000	848.000	5,088,000
アサンテ	5,200	1,644.000	8,548,800
バリューHR	7,700	1,590.000	12,243,000
M&Aキャピタルパートナーズ	7,600	4,535.000	34,466,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,300	1,121.000	4,820,300
E R Iホールディングス	2,700	1,473.000	3,977,100
シグマクス・ホールディングス	12,600	1,102.000	13,885,200
ウィルグループ	7,100	1,123.000	7,973,300
メドピア	6,800	1,369.000	9,309,200
リクルートホールディングス	601,000	3,809.000	2,289,209,000
エラン	10,500	1,067.000	11,203,500
日本郵政	1,065,300	1,219.500	1,299,133,350
ベルシステム24ホールディングス	11,400	1,478.000	16,849,200
鎌倉新書	10,100	1,091.000	11,019,100
エアトリ	5,600	2,551.000	14,285,600
アトラエ	7,000	995.000	6,965,000
ストライク	4,100	4,080.000	16,728,000
ソラスト	23,400	679.000	15,888,600
セラク	3,300	1,443.000	4,761,900
インソース	20,300	1,309.000	26,572,700
ベイカレント・コンサルティング	64,300	5,590.000	359,437,000
Orchestra Holdings	2,000	1,875.000	3,750,000
アイモバイル	5,100	1,241.000	6,329,100
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	30,000	2,005.000	60,150,000
ウェルビー	7,700	659.000	5,074,300
エル・ティー・エス	1,300	2,478.000	3,221,400
ミダックホールディングス	5,000	2,779.000	13,895,000
日総工産	7,200	661.000	4,759,200
キュービーネットホールディングス	4,700	1,452.000	6,824,400
R P Aホールディングス	14,700	340.000	4,998,000
マネジメントソリューションズ	4,600	3,690.000	16,974,000
フロンティア・マネジメント	3,300	1,306.000	4,309,800
カーブスホールディングス	25,500	782.000	19,941,000
FAST FITNESS JAPAN	3,600	1,371.000	4,935,600
ダイレクトマーケティングミックス	10,200	1,613.000	16,452,600
L I T A L I C O	6,600	2,589.000	17,087,400
リログループ	45,500	2,168.000	98,644,000

東祥	7,000	1,189.000	8,323,000	
TREホールディングス	17,600	1,482.000	26,083,200	
人・夢・技術グループ	4,100	1,527.000	6,260,700	
大栄環境	15,700	1,751.000	27,490,700	
エイチ・アイ・エス	21,600	2,091.000	45,165,600	
ラックランド	3,100	2,898.000	8,983,800	
共立メンテナンス	14,000	5,270.000	73,780,000	
イチネンホールディングス	9,000	1,272.000	11,448,000	
建設技術研究所	4,900	3,480.000	17,052,000	
スペース	7,400	890.000	6,586,000	
燦ホールディングス	4,200	2,080.000	8,736,000	
スバル興業	800	9,180.000	7,344,000	
東京テアトル	8,800	1,130.000	9,944,000	
ナガワ	2,200	7,600.000	16,720,000	
東京都競馬	7,100	3,725.000	26,447,500	
カナモト	15,000	2,226.000	33,390,000	
西尾レントオール	7,600	3,110.000	23,636,000	
トランス・コスモス	10,200	3,385.000	34,527,000	
乃村工藝社	35,900	898.000	32,238,200	
藤田観光	4,100	3,315.000	13,591,500	
KNT-CTホールディングス	4,400	1,713.000	7,537,200	
日本管財	9,000	2,551.000	22,959,000	
トーカイ	7,500	1,904.000	14,280,000	
セコム	82,700	7,875.000	651,262,500	
セントラル警備保障	4,800	2,490.000	11,952,000	
丹青社	17,200	712.000	12,246,400	
メイテック	32,600	2,431.000	79,250,600	
応用地質	7,800	1,998.000	15,584,400	
船井総研ホールディングス	17,500	2,782.000	48,685,000	
いであ	2,600	1,526.000	3,967,600	
学究社	4,200	2,011.000	8,446,200	
ベネッセホールディングス	31,100	1,976.000	61,453,600	
イオンディライト	9,100	3,020.000	27,482,000	
ダイセキ	16,600	4,025.000	66,815,000	
ステップ	3,800	1,776.000	6,748,800	
合計	91,072,600		227,099,948,860	

## (b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位：円)

(2022年2月18日現在)

(2023年2月20日現在)

資産の部		
流動資産		
金銭信託	11,754,192	19,179,591
コール・ローン	389,804,746	379,284,508
国債証券	103,251,731,330	93,914,832,360
地方債証券	9,588,458,300	9,327,354,900
特殊債券	9,447,523,174	8,983,279,483
社債券	5,297,396,900	6,536,207,600
未収入金	508,302,200	83,000,000
未収利息	356,702,726	306,540,887
前払費用	4,632,157	8,217,910
流動資産合計	128,856,305,725	119,557,897,239
資産合計	128,856,305,725	119,557,897,239
負債の部		
流動負債		
未払金	200,000,000	-
未払解約金	223,632,227	35,371,000
その他未払費用	753	1,034
流動負債合計	423,632,980	35,372,034
負債合計	423,632,980	35,372,034
純資産の部		
元本等		
元本	102,053,846,373	98,468,499,154
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	26,378,826,372	21,054,026,051
元本等合計	128,432,672,745	119,522,525,205
純資産合計	128,432,672,745	119,522,525,205
負債純資産合計	128,856,305,725	119,557,897,239

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2022年2月19日 至 2023年2月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p>

	<p>(3) 時価が入手できなかった有価証券</p> <p>直近の最終相場等によって時価評価することが適切ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
--	--

（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	（2022年2月18日現在）	（2023年2月20日現在）
1. 当計算期間の末日における 受益権の総数	102,053,846,373口	98,468,499,154口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2585円 （1万口当たりの純資産額12,585円）	1口当たり純資産額 1.2138円 （1万口当たりの純資産額12,138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 2022年2月19日 至 2023年2月20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、地方債証券、特殊債券、社債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。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項 目	(2023年2月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <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 2022年2月19日

至 2023年2月20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)

(2022年2月18日現在)

## 開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	100,129,074,120円
同期中における追加設定元本額	17,663,518,982円
同期中における一部解約元本額	15,738,746,729円
2022年2月18日現在の元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	6,655,940,182円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	11,416,731,765円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,611,374,720円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	811,383,592円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	43,771,585円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	197,469,805円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	477,710,690円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	720,810,481円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	341,197,909円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	493,301,432円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	146,777,854円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,106,558,375円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	337,487,521円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	15,533,572円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	44,807,171円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,918,698,861円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	641,421,985円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	990,386,432円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	229,284,271円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	84,963,102円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	146,654,699円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	106,995,569円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	200,242,215円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	57,564,692円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	5,951,548円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,448,683,462円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	12,422,883,716円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	6,372,792,213円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	16,011,855,332円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	319,334,808円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	565,801,602円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	265,754,075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>	119,806,572円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,887,217,652円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,215,198,814円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,371,642,862円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	8,596,867,318円

S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	972,339円
三井住友・国内債券インデックスファンド・V A S ( 適格機関投資家専用 )	1,198,994,627円
S M A M ・ グローバルバランス 4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	444,446,764円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	547,012,597円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	180,274,882円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	43,674,401円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	1,457,491,849円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	2,120,941,549円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	699,571,659円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	210,722,470円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	19,095,952円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 0 L 2 < 適格機関投資家専用 >	278,445,136円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	5,230,302,006円
S M A M ・ 年金 W リスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	997,745,813円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	1,060,685,582円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	1,356,845,714円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	3,805,764,579円
合 計	102,053,846,373円

( 2023年2月20日現在 )

## 開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	102,053,846,373円
同期中における追加設定元本額	27,964,043,892円
同期中における一部解約元本額	31,549,391,111円

## 2023年2月20日現在の元本の内訳

三井住友・D C 年金バランス 3 0 ( 債券重点型 )	7,923,460,658円
三井住友・D C 年金バランス 5 0 ( 標準型 )	12,755,531,327円
三井住友・D C 年金バランス 7 0 ( 株式重点型 )	3,025,477,132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 )	722,058,897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 )	41,625,383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 )	198,031,820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 )	548,196,469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 )	939,015,409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 )	497,124,584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 )	629,401,805円
三井住友・D C 年金バランスゼロ ( 債券型 )	142,965,910円
アセットアロケーション・ファンド ( 安定型 )	988,245,910円
アセットアロケーション・ファンド ( 安定成長型 )	334,157,236円
アセットアロケーション・ファンド ( 成長型 )	13,049,588円
三井住友 D S ・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 5 0	67,640,670円
三井住友・資産最適化ファンド ( 1 安定重視型 )	2,175,938,455円
三井住友・資産最適化ファンド ( 2 やや安定型 )	745,900,911円
三井住友・資産最適化ファンド ( 3 バランス型 )	1,138,229,302円
三井住友・資産最適化ファンド ( 4 やや成長型 )	256,092,408円
三井住友・資産最適化ファンド ( 5 成長重視型 )	41,823,338円
三井住友・D C つみたて N I S A ・ 世界分散ファンド	221,791,251円

三井住友D S ・年金バランス30 (債券重点型)	314,254,587円
三井住友D S ・年金バランス50 (標準型)	614,543,782円
三井住友D S ・年金バランス70 (株式重点型)	178,682,271円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2060	8,810,148円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2035	363,085円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2040	298,337円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2045	201,623円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2055	109,828円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2065	109,828円
S M A M ・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,165,585,383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>	10,131,272,966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>	5,883,975,871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>	14,827,042,772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>	299,804,746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>	469,103,658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>	252,747,789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>	120,221,118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>	1,758,891,118円
S M A M ・インデックス・バランスV A 5 0 <適格機関投資家専用>	2,036,392,293円
S M A M ・バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用>	2,141,556,909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>	7,715,877,192円
S M A M ・バランスV A 株40 T <適格機関投資家限定>	961,967円
三井住友・国内債券インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	1,077,378,938円
S M A M ・グローバルバランス40 V A <適格機関投資家限定>	385,918,055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>	476,420,978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>	165,177,003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>	44,327,528円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 0 L <適格機関投資家専用>	1,259,376,954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>	1,957,126,760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>	615,082,574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>	209,309,392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>	20,824,733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>	256,032,422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>	4,751,028,753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>	1,287,393,245円
S M A M ・マルチアセットストラテジーファンド2016 - 04 <適格機関投資家限定>	1,232,850,854円
S M A M ・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	1,576,598,738円
S M A M ・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド <適格機関投資家限定>	1,827,086,493円
合 計	98,468,499,154円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	4 4 4 2年国債	5,830,000,000	5,837,054,300	
	4 4 5 2年国債	60,000,000	60,058,200	
	1 4 3 5年国債	770,000,000	772,317,700	
	1 4 4 5年国債	980,000,000	983,077,200	
	1 4 5 5年国債	1,180,000,000	1,183,799,600	
	1 4 6 5年国債	1,000,000,000	1,003,110,000	
	1 4 7 5年国債	1,460,000,000	1,460,000,000	
	1 4 8 5年国債	1,130,000,000	1,129,242,900	
	1 4 9 5年国債	1,240,000,000	1,237,780,400	
	1 5 0 5年国債	1,230,000,000	1,226,236,200	
	1 5 1 5年国債	230,000,000	228,925,900	
	1 5 2 5年国債	340,000,000	339,721,200	
	1 5 3 5年国債	1,140,000,000	1,132,886,400	
	1 5 4 5年国債	1,170,000,000	1,165,741,200	
	1 5 5 5年国債	120,000,000	120,573,600	
	1 4 0年国債	40,000,000	47,867,600	
	2 4 0年国債	242,000,000	279,512,420	
	3 4 0年国債	185,000,000	214,056,100	
	4 4 0年国債	247,000,000	286,243,360	
	5 4 0年国債	235,000,000	263,317,500	
	6 4 0年国債	240,000,000	262,891,200	
	7 4 0年国債	265,000,000	277,704,100	
	8 4 0年国債	250,000,000	243,267,500	
	9 4 0年国債	483,000,000	344,596,350	
	1 0 4 0年国債	420,000,000	352,833,600	
	1 1 4 0年国債	340,000,000	275,179,000	
	1 2 4 0年国債	370,000,000	267,424,900	
	1 3 4 0年国債	425,000,000	306,233,750	
	1 4 4 0年国債	435,000,000	335,228,400	
	1 5 4 0年国債	400,000,000	335,440,000	
	3 3 6 1 0年国債	340,000,000	343,481,600	
	3 3 7 1 0年国債	120,000,000	120,789,600	
	3 3 8 1 0年国債	805,000,000	812,430,150	
	3 3 9 1 0年国債	785,000,000	792,944,200	
	3 4 0 1 0年国債	770,000,000	778,439,200	
	3 4 1 1 0年国債	557,000,000	561,879,320	
	3 4 2 1 0年国債	350,000,000	351,018,500	
	3 4 3 1 0年国債	310,000,000	310,771,900	
	3 4 4 1 0年国債	811,000,000	812,297,600	
	3 4 5 1 0年国債	258,000,000	258,147,060	
	3 4 6 1 0年国債	340,000,000	339,721,200	
	3 4 7 1 0年国債	100,000,000	99,785,000	
3 4 8 1 0年国債	145,000,000	144,472,200		
3 4 9 1 0年国債	550,000,000	547,365,500		

350	10年国債	510,000,000	506,547,300	
351	10年国債	450,000,000	446,098,500	
352	10年国債	100,000,000	98,957,000	
353	10年国債	450,000,000	444,460,500	
354	10年国債	695,000,000	685,068,450	
355	10年国債	600,000,000	590,166,000	
356	10年国債	870,000,000	854,087,700	
357	10年国債	650,000,000	636,824,500	
358	10年国債	940,000,000	919,649,000	
359	10年国債	1,000,000,000	975,170,000	
360	10年国債	910,000,000	884,383,500	
361	10年国債	300,000,000	290,523,000	
362	10年国債	1,150,000,000	1,110,842,500	
363	10年国債	1,610,000,000	1,552,313,700	
364	10年国債	300,000,000	288,822,000	
365	10年国債	890,000,000	856,277,900	
367	10年国債	840,000,000	828,240,000	
368	10年国債	660,000,000	658,449,000	
369	10年国債	1,110,000,000	1,110,000,000	
2	30年国債	510,000,000	580,017,900	
4	30年国債	340,000,000	401,890,200	
5	30年国債	290,000,000	328,889,000	
7	30年国債	474,000,000	546,943,860	
9	30年国債	240,000,000	256,982,400	
10	30年国債	465,000,000	484,097,550	
11	30年国債	430,000,000	472,544,200	
12	30年国債	570,000,000	649,230,000	
14	30年国債	392,000,000	459,306,400	
16	30年国債	445,000,000	527,115,850	
18	30年国債	190,000,000	221,013,700	
19	30年国債	470,000,000	547,253,900	
21	30年国債	345,000,000	402,159,600	
22	30年国債	315,000,000	375,051,600	
23	30年国債	299,000,000	355,923,620	
24	30年国債	310,000,000	369,340,200	
25	30年国債	290,000,000	338,261,800	
26	30年国債	363,000,000	428,340,000	
27	30年国債	250,000,000	298,470,000	
28	30年国債	96,000,000	114,637,440	
29	30年国債	157,000,000	185,376,180	
30	30年国債	212,000,000	247,253,480	
31	30年国債	235,000,000	270,675,350	
32	30年国債	360,000,000	419,680,800	
33	30年国債	368,000,000	411,630,080	
34	30年国債	87,000,000	99,995,190	

35	30年国債	340,000,000	379,875,200	
36	30年国債	90,000,000	100,628,100	
37	30年国債	385,000,000	423,692,500	
38	30年国債	220,000,000	238,079,600	
39	30年国債	220,000,000	241,804,200	
40	30年国債	240,000,000	259,480,800	
41	30年国債	240,000,000	255,105,600	
42	30年国債	280,000,000	297,295,600	
43	30年国債	225,000,000	238,830,750	
44	30年国債	290,000,000	307,472,500	
45	30年国債	315,000,000	321,879,600	
46	30年国債	315,000,000	321,665,400	
47	30年国債	540,000,000	561,232,800	
49	30年国債	345,000,000	344,699,850	
50	30年国債	325,000,000	286,247,000	
51	30年国債	265,000,000	206,654,950	
52	30年国債	323,000,000	263,752,110	
53	30年国債	277,000,000	231,006,920	
54	30年国債	75,000,000	65,367,000	
55	30年国債	265,000,000	230,295,600	
56	30年国債	300,000,000	259,953,000	
57	30年国債	265,000,000	228,954,700	
58	30年国債	420,000,000	362,140,800	
59	30年国債	350,000,000	293,755,000	
60	30年国債	330,000,000	290,178,900	
61	30年国債	285,000,000	237,687,150	
62	30年国債	235,000,000	185,391,500	
63	30年国債	230,000,000	175,779,800	
64	30年国債	255,000,000	194,312,550	
65	30年国債	235,000,000	178,712,800	
66	30年国債	310,000,000	234,843,600	
67	30年国債	320,000,000	255,513,600	
68	30年国債	310,000,000	247,135,100	
69	30年国債	310,000,000	253,834,200	
70	30年国債	350,000,000	285,929,000	
71	30年国債	370,000,000	301,853,400	
72	30年国債	340,000,000	278,079,200	
73	30年国債	290,000,000	236,872,000	
74	30年国債	320,000,000	283,305,600	
75	30年国債	210,000,000	200,627,700	
76	30年国債	450,000,000	440,325,000	
77	30年国債	70,000,000	71,589,700	
75	20年国債	490,000,000	511,814,800	
78	20年国債	590,000,000	616,573,600	
82	20年国債	620,000,000	653,982,200	

84	20年国債	500,000,000	528,420,000	
85	20年国債	645,000,000	686,525,100	
88	20年国債	742,000,000	798,095,200	
89	20年国債	20,000,000	21,445,600	
90	20年国債	580,000,000	624,422,200	
92	20年国債	324,000,000	348,905,880	
93	20年国債	632,000,000	680,303,760	
95	20年国債	305,000,000	333,255,200	
97	20年国債	327,000,000	357,070,920	
99	20年国債	153,000,000	166,938,300	
100	20年国債	207,000,000	227,507,490	
101	20年国債	355,000,000	393,734,050	
102	20年国債	457,000,000	508,508,470	
105	20年国債	370,000,000	407,096,200	
106	20年国債	370,000,000	409,127,500	
107	20年国債	378,000,000	416,968,020	
108	20年国債	390,000,000	425,735,700	
109	20年国債	140,000,000	153,133,400	
111	20年国債	386,000,000	430,328,240	
113	20年国債	227,000,000	252,299,150	
114	20年国債	263,000,000	293,102,980	
116	20年国債	100,000,000	112,460,000	
118	20年国債	200,000,000	222,380,000	
119	20年国債	295,000,000	323,703,500	
120	20年国債	200,000,000	216,618,000	
121	20年国債	55,000,000	60,799,200	
122	20年国債	330,000,000	362,379,600	
123	20年国債	80,000,000	89,742,400	
124	20年国債	190,000,000	211,705,600	
125	20年国債	205,000,000	232,045,650	
126	20年国債	180,000,000	200,874,600	
127	20年国債	145,000,000	160,690,450	
128	20年国債	65,000,000	72,187,050	
130	20年国債	155,000,000	171,151,000	
131	20年国債	380,000,000	416,476,200	
132	20年国債	450,000,000	493,978,500	
133	20年国債	190,000,000	210,170,400	
134	20年国債	200,000,000	221,606,000	
135	20年国債	155,000,000	170,331,050	
136	20年国債	120,000,000	130,832,400	
137	20年国債	185,000,000	203,601,750	
139	20年国債	60,000,000	65,501,400	
140	20年国債	420,000,000	462,264,600	
141	20年国債	360,000,000	395,830,800	
142	20年国債	240,000,000	266,107,200	

143	20年国債	150,000,000	163,395,000	
144	20年国債	170,000,000	183,574,500	
145	20年国債	110,000,000	120,883,400	
146	20年国債	215,000,000	236,173,200	
147	20年国債	260,000,000	282,838,400	
148	20年国債	319,000,000	343,460,920	
149	20年国債	495,000,000	532,362,600	
150	20年国債	451,000,000	479,670,070	
151	20年国債	420,000,000	436,497,600	
153	20年国債	527,000,000	552,222,220	
154	20年国債	440,000,000	455,171,200	
155	20年国債	410,000,000	413,526,000	
157	20年国債	865,000,000	781,787,000	
158	20年国債	380,000,000	356,432,400	
159	20年国債	388,000,000	367,804,600	
160	20年国債	295,000,000	282,512,650	
161	20年国債	380,000,000	357,811,800	
162	20年国債	410,000,000	384,485,700	
163	20年国債	430,000,000	401,822,100	
164	20年国債	405,000,000	371,417,400	
165	20年国債	410,000,000	374,543,200	
166	20年国債	445,000,000	417,712,600	
167	20年国債	610,000,000	553,202,900	
168	20年国債	450,000,000	399,870,000	
169	20年国債	400,000,000	348,236,000	
170	20年国債	405,000,000	350,956,800	
171	20年国債	385,000,000	332,070,200	
172	20年国債	480,000,000	419,635,200	
173	20年国債	365,000,000	317,648,550	
174	20年国債	550,000,000	476,784,000	
175	20年国債	565,000,000	496,702,800	
176	20年国債	670,000,000	586,826,200	
177	20年国債	590,000,000	505,795,200	
178	20年国債	650,000,000	565,831,500	
179	20年国債	400,000,000	347,132,000	
180	20年国債	500,000,000	457,940,000	
181	20年国債	450,000,000	418,959,000	
182	20年国債	410,000,000	394,735,700	
183	20年国債	80,000,000	81,005,600	
	国債証券 小計		93,914,832,360	
地方債証券	727 東京都公債	500,000,000	502,942,500	
	1 東京都30年	100,000,000	112,742,100	
	8 東京都30年	400,000,000	450,686,400	
	13 東京都30年	500,000,000	541,678,500	
	6 東京都20年	100,000,000	103,975,400	



26-15	北海道公債	100,000,000	100,661,000	
30-18	北海道公債	200,000,000	195,315,200	
208	神奈川県公債	200,000,000	201,346,400	
210	神奈川県公債	100,000,000	100,707,400	
211	神奈川県公債	100,000,000	100,687,300	
1	神奈川県20年	100,000,000	103,326,500	
3	神奈川県20年	100,000,000	104,694,200	
7	神奈川県20年	100,000,000	107,984,400	
13	神奈川県20年	100,000,000	110,949,400	
377	大阪府公債	100,000,000	100,486,000	
388	大阪府公債	100,000,000	100,720,200	
392	大阪府公債	100,000,000	100,504,700	
193	大阪府5年	300,000,000	296,531,400	
27-4	京都府公債	100,000,000	101,067,600	
1-6	京都府5年	200,000,000	199,808,200	
5	兵庫県公債15年	300,000,000	313,563,600	
10	兵庫県公債20年	100,000,000	110,776,800	
7	静岡県30年	100,000,000	109,018,600	
1	静岡県20年	100,000,000	105,354,000	
22-8	愛知県20年	200,000,000	218,020,600	
27-16	愛知県公債	400,000,000	403,886,000	
25-11	福岡県公債	100,000,000	100,679,800	
26-3	福岡県公債	100,000,000	100,762,400	
26-10	福岡県公債	100,000,000	100,759,400	
1-1	福岡県公債	200,000,000	193,719,400	
1-3	福岡県30年	100,000,000	74,230,000	
25-8	千葉県公債	100,000,000	100,497,400	
26-4	千葉県公債	100,000,000	100,779,800	
137	共同発行地方	200,000,000	201,527,000	
138	共同発行地方	200,000,000	201,559,600	
172	共同発行地方	500,000,000	498,647,000	
183	共同発行地方	600,000,000	593,820,600	
1-1	大阪市5年	300,000,000	299,872,800	
1	名古屋市20年	200,000,000	203,276,800	
3	名古屋市20年	100,000,000	104,505,900	
5	名古屋市20年	100,000,000	107,554,100	
1	京都市30年	100,000,000	117,270,500	
7	京都市20年	100,000,000	110,585,000	
26-4	神戸市公債	200,000,000	201,558,600	
26-17	神戸市公債	100,000,000	100,405,200	
26-3	横浜市公債	200,000,000	201,529,000	
4	横浜市20年	100,000,000	104,035,300	
9	横浜市20年	100,000,000	107,295,100	
14	横浜市20年	100,000,000	109,833,800	
26-4	札幌市公債	100,000,000	100,662,600	

	9 4 川崎市公債	100,000,000	94,649,700	
	1 - 2 北九州市5年	100,000,000	99,903,700	
	地方債証券 小計		9,327,354,900	
特殊債券	4 7 日本政策投資C O	100,000,000	102,547,400	
	3 政保政策投資C O	200,000,000	203,532,000	
	3 6 日本政策投資B	100,000,000	107,892,500	
	1 8 道路機構	100,000,000	123,572,800	
	2 2 道路機構	300,000,000	358,537,200	
	2 7 道路機構	100,000,000	108,920,400	
	3 7 道路機構	300,000,000	330,325,500	
	4 7 道路機構	200,000,000	221,967,400	
	7 9 政保道路機構	200,000,000	220,124,000	
	8 1 政保道路機構	200,000,000	220,350,600	
	8 8 政保道路機構	100,000,000	115,249,600	
	9 0 政保道路機構	500,000,000	552,581,500	
	9 9 政保道路機構	100,000,000	111,585,800	
	1 7 6 政保道路機構	100,000,000	110,625,900	
	1 9 6 政保道路機構	100,000,000	109,045,900	
	2 1 0 政保道路機構	200,000,000	212,837,800	
	2 2 7 政保道路機構	200,000,000	201,701,400	
	2 3 1 政保道路機構	300,000,000	302,554,800	
	2 8 8 政保道路機構	189,000,000	188,138,160	
	9 道路債券	100,000,000	119,512,400	
	2 地方公営20年	100,000,000	110,276,400	
	6 1 地方公共団体	100,000,000	100,801,400	
	6 2 地方公共団体	400,000,000	402,992,800	
	6 3 地方公共団体	100,000,000	100,703,700	
	6 4 地方公共団体	100,000,000	100,710,200	
	6 7 政保地方公共団	100,000,000	100,824,100	
	1 0 1 地方公共団体	100,000,000	99,191,000	
	1 0 6 地方公共団体	200,000,000	197,490,000	
	5 公営企業20年	100,000,000	101,193,200	
	1 7 公営企業20年	100,000,000	106,664,800	
	2 0 公営企業20年	100,000,000	107,735,100	
	2 2 公営企業20年	100,000,000	108,353,000	
	2 4 公営企業20年	200,000,000	218,545,400	
	1 1 7 都市再生	100,000,000	100,398,300	
	5 2 住宅支援機構	100,000,000	109,259,600	
	9 3 住宅支援機構	100,000,000	104,772,800	
	1 2 4 住宅支援機構	100,000,000	104,811,600	
	1 3 0 住宅支援機構	200,000,000	216,764,200	
	2 2 6 住宅支援機構	100,000,000	99,138,400	
	S 1 0 住宅金融R M B S	28,494,000	28,565,235	
	S 3 住宅機構R M B S	10,115,000	10,140,287	
	S 5 住宅機構R M B S	21,454,000	21,677,121	

S 7	住宅機構 R M B S	11,003,000	11,188,950	
S 9	住宅機構 R M B S	11,252,000	11,472,539	
S 1 0	住宅機構 R M B S	11,017,000	11,212,000	
S 1 1	住宅機構 R M B S	11,870,000	12,170,311	
3 2	住宅金融 R M B S	10,034,000	10,053,064	
3 5	住宅金融 R M B S	10,760,000	10,855,764	
3 9	住宅金融 R M B S	9,754,000	9,774,483	
4 1	住宅金融 R M B S	10,482,000	10,594,157	
4 3	住宅金融 R M B S	20,056,000	20,110,151	
5 1	住宅金融 R M B S	9,572,000	9,595,930	
5 3	住宅金融 R M B S	10,382,000	10,495,163	
2	住宅機構 R M B S	21,236,000	21,490,832	
4	住宅機構 R M B S	9,766,000	9,792,368	
6	住宅機構 R M B S	9,817,000	9,841,542	
1 9	住宅機構 R M B S	14,425,000	15,002,000	
2 4	住宅機構 R M B S	28,872,000	30,174,127	
2 6	住宅機構 R M B S	46,107,000	48,209,479	
2 7	住宅機構 R M B S	16,224,000	16,988,150	
2 8	住宅機構 R M B S	18,549,000	19,528,387	
2 9	住宅機構 R M B S	20,217,000	21,339,043	
3 0	住宅機構 R M B S	19,887,000	20,990,728	
3 2	住宅機構 R M B S	38,996,000	40,879,506	
3 5	住宅機構 R M B S	19,933,000	20,929,650	
3 6	住宅機構 R M B S	19,219,000	20,110,761	
4 3	住宅機構 R M B S	24,516,000	25,653,542	
4 6	住宅機構 R M B S	19,210,000	20,134,001	
4 8	住宅機構 R M B S	36,270,000	37,971,063	
4 9	住宅機構 R M B S	18,489,000	19,287,724	
5 1	住宅機構 R M B S	40,250,000	41,928,425	
5 5	住宅機構 R M B S	53,712,000	55,747,684	
5 7	住宅機構 R M B S	25,749,000	26,740,336	
5 8	住宅機構 R M B S	28,730,000	29,838,978	
5 9	住宅機構 R M B S	55,078,000	57,270,104	
6 0	住宅機構 R M B S	83,865,000	86,842,207	
6 1	住宅機構 R M B S	28,211,000	29,113,752	
6 7	住宅機構 R M B S	35,649,000	36,451,102	
6 9	住宅機構 R M B S	74,132,000	76,496,810	
7 0	住宅機構 R M B S	65,246,000	67,301,249	
7 3	住宅機構 R M B S	37,094,000	38,325,520	
9 9	住宅機構 R M B S	56,873,000	57,072,055	
1 2 3	住宅機構 R M B S	74,666,000	72,172,155	
1 2 4	住宅機構 R M B S	74,537,000	71,816,399	
1 2 5	住宅機構 R M B S	74,532,000	71,826,488	
1 2 7	住宅機構 R M B S	76,443,000	73,431,145	
1 2 8	住宅機構 R M B S	75,416,000	72,595,441	

	1 2 9 住宅機構 R M B S	77,178,000	74,415,027	
	1 3 7 住宅機構 R M B S	79,468,000	76,384,641	
	1 6 7 住宅機構 R M B S	92,306,000	87,543,010	
	1 8 3 住宅機構 R M B S	196,128,000	186,655,017	
	1 8 6 住宅機構 R M B S	99,159,000	96,303,220	
	8 5 中日本高速道	300,000,000	298,551,600	
	特殊債券 小計		8,983,279,483	
社債券	2 BPCE S.A.	200,000,000	200,010,000	
	8 6 東日本高速道	200,000,000	197,429,000	
	2 0 西日本高速道	100,000,000	100,384,800	
	2 3 西日本高速道	100,000,000	100,634,100	
	1 3 大和ハウス	100,000,000	99,241,000	
	1 7 アサヒグループHD	200,000,000	198,565,600	
	3 0 東レ	100,000,000	99,483,200	
	5 6 住友化学	200,000,000	197,441,400	
	2 4 三菱ケミカルホールデイ	100,000,000	98,322,000	
	1 6 日立製作所	100,000,000	100,597,700	
	2 2 パナソニック	100,000,000	98,019,600	
	9 T D K	100,000,000	96,937,300	
	6 3 三井物産	100,000,000	107,863,000	
	8 みずほコーポレート	100,000,000	108,874,600	
	1 三井住友 F G 劣後	100,000,000	100,570,800	
	8 住友信託 劣後	100,000,000	107,137,900	
	1 みずほ F G 劣後	100,000,000	100,569,800	
	9 みずほ銀行劣後	100,000,000	107,127,300	
	1 7 N T Tファイナンス	200,000,000	197,524,200	
	7 3 ホンダファイナンス	200,000,000	197,851,400	
	2 0 7 オリックス	200,000,000	196,631,400	
	2 三菱H C キャピタル	200,000,000	196,084,800	
	1 野村ホールディングス	100,000,000	99,945,600	
	5 8 三菱地所	100,000,000	118,337,100	
	1 3 5 三菱地所	200,000,000	189,071,600	
	1 0 東急	100,000,000	93,962,300	
	3 8 京王電鉄	100,000,000	99,002,800	
	1 1 0 東日本旅客鉄	100,000,000	100,532,600	
	1 6 9 東日本旅客鉄	200,000,000	187,116,400	
	6 0 西日本旅客鉄	200,000,000	192,131,200	
	4 1 東海旅客鉄道	100,000,000	108,755,700	
	4 2 東海旅客鉄道	100,000,000	109,765,400	
	4 5 東京地下鉄	100,000,000	95,177,100	
	6 4 阪急阪神H L D G	100,000,000	98,974,100	
	3 1 K D D I	200,000,000	199,222,600	
	5 4 6 中部電力	200,000,000	185,207,000	
	5 5 3 中部電力	200,000,000	197,918,000	
	5 5 0 関西電力	300,000,000	297,545,100	

508	東北電力	200,000,000	194,682,400	
547	東北電力	100,000,000	97,337,200	
496	九州電力	300,000,000	278,160,000	
38	東京電力パワー	100,000,000	99,702,600	
56	東京電力PG	200,000,000	199,218,600	
41	大阪瓦斯	200,000,000	188,298,400	
7	ファーストリテイリング	100,000,000	98,842,900	
	社債券 小計		6,536,207,600	
	合計		118,761,674,343	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 外国株式インデックス・マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2022年2月18日現在)	(2023年2月20日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
預金	2,883,879,727	6,810,869,309
金銭信託	32,714,820	25,870,400
コール・ローン	1,084,922,886	511,598,077
株式	331,942,389,153	447,345,580,983
投資証券	8,024,316,993	10,991,824,558
派生商品評価勘定	20,243,668	73,653,121
未収入金	57,653,943	146,885,647
未収配当金	308,088,498	526,630,908
差入委託証拠金	1,831,575,820	2,800,185,211
流動資産合計	346,185,785,508	469,233,098,214
<b>資産合計</b>		
	346,185,785,508	469,233,098,214
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
派生商品評価勘定	55,364,690	29,809,652
未払解約金	783,550,584	327,539,394
その他未払費用	1,369	2,482
流動負債合計	838,916,643	357,351,528
<b>負債合計</b>		
	838,916,643	357,351,528
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	61,407,657,975	75,342,567,898
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	283,939,210,890	393,533,178,788
元本等合計	345,346,868,865	468,875,746,686
<b>純資産合計</b>		
	345,346,868,865	468,875,746,686
<b>負債純資産合計</b>		
	346,185,785,508	469,233,098,214

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2022年2月19日 至 2023年2月20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	( 2022年2月18日現在 )	( 2023年2月20日現在 )
1. 当計算期間の末日における 受益権の総数	61,407,657,975口	75,342,567,898口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 5.6238円 ( 1万口当たりの純資産額56,238円 )	1口当たり純資産額 6.2233円 ( 1万口当たりの純資産額62,233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 2022年2月19日 至 2023年2月20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>
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	(2023年2月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(株式、投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2022年2月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

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

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
為替予約取引 買建					
	アメリカ・ドル	469,698,762	-	468,965,001	733,761
	カナダ・ドル	16,283,628	-	16,272,310	11,318
	オーストラリア・ドル	9,946,672	-	9,897,404	49,268
	香港・ドル	6,350,317	-	6,337,437	12,880
	シンガポール・ドル	1,715,733	-	1,711,822	3,911



市場取引以外の取引	ニュージーランド・ドル	772,270	-	768,900	3,370
	イギリス・ポンド	26,613,014	-	26,588,778	24,236
	イスラエル・シェケル	1,436,395	-	1,431,722	4,673
	スイス・フラン	21,259,620	-	21,234,567	25,053
	デンマーク・クローネ	5,450,034	-	5,441,095	8,939
	ノルウェー・クローネ	776,814	-	773,302	3,512
	スウェーデン・クローナ	7,272,104	-	7,257,000	15,104
	ユーロ	49,640,490	-	49,618,969	21,521
	小計	617,215,853	-	616,298,307	917,546
合 計		617,215,853	-	616,298,307	917,546

(2023年2月20日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	S&P 500 EMINI FUT MAR23	7,905,483,534	-	7,913,727,000	8,243,466
	SPI 200 FUTURES MAR23	393,279,635	-	386,174,842	7,104,793
	FTSE 100 IDX FUT MAR23	466,505,042	-	476,212,955	9,707,913
	EURO STOXX 50 MAR23	1,597,424,312	-	1,627,917,260	30,492,948
	小計	10,362,692,523	-	10,404,032,057	41,339,534
合 計		10,362,692,523	-	10,404,032,057	41,339,534

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち 1年超		
	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	224,229,369	-	227,189,742	2,960,373
	イギリス・ポンド	43,320,618	-	43,306,414	14,204

市場取引以 外の取引	小計	267,549,987	-	270,496,156	2,946,169
	売建				
	イギリス・ポンド	16,066,830	-	16,157,210	90,380
	ユーロ	109,717,874	-	110,069,727	351,853
	小計	125,784,704	-	126,226,937	442,233
	合 計	393,334,691	-	396,723,093	2,503,936

## (注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

自 2022年2月19日 至 2023年2月20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)

(2022年2月18日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	58,766,657,288円
同期中における追加設定元本額	13,897,863,438円
同期中における一部解約元本額	11,256,862,751円
2022年2月18日現在の元本の内訳	
三井住友・DC 外国株式インデックスファンド S	32,224,488,074円
三井住友・DC 年金バランス 30 (債券重点型)	267,740,321円
三井住友・DC 年金バランス 50 (標準型)	1,086,252,349円
三井住友・DC 年金バランス 70 (株式重点型)	769,361,737円
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)	50,131,931円
三井住友・DC ターゲットイヤーファンド 2020 (4資産タイプ)	1,172,766円
三井住友・DC ターゲットイヤーファンド 2025 (4資産タイプ)	6,019,213円
三井住友・DC ターゲットイヤーファンド 2030 (4資産タイプ)	17,882,397円
三井住友・DC ターゲットイヤーファンド 2035 (4資産タイプ)	48,968,012円
三井住友・DC ターゲットイヤーファンド 2040 (4資産タイプ)	51,247,016円

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	97,638,793円
外国株式指数ファンド	832,266,976円
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	13,549,725,594円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	176,436,603円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	203,184,616円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	129,304,051円
イオン・バランス戦略ファンド	14,159,067円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	15,873,266円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	121,558,830円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	107,101,698円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	367,788,050円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	190,350,995円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	221,270,706円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	42,907,633円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	631,760,314円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	4,312,302円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	18,997,088円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	16,653,445円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,126,325円
SMB C・DCインデックスファンド(M S C Iコクサイ)	135,053,059円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	138,305,233円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	494,524,360円
三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド	18,407,244円
S M A M・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	547,572,635円
バランスファンドV A(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	4,050,001円
S M A M・バランスファンドV A安定成長型 < 適格機関投資家限定 >	28,727,858円
S M A M・バランスファンドV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	667,997,195円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >	802,068,341円
S M A M・バランスファンドV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	3,487,539,177円
S M A M・バランスファンドV L 3 0 < 適格機関投資家限定 >	11,523,953円
S M A M・バランスファンドV L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	62,266,508円
S M A M・バランスファンドV A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	467,481,408円
S M A M・バランスファンドV L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	39,529,370円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	102,099,408円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	486,937,001円
S M A M・バランスファンドV A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	339,113,420円
S M A M・バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	789,808,587円
S M A M・バランスV A株40T < 適格機関投資家限定 >	213,357円
三井住友・外国株式インデックスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	213,566,235円
S M A M・グローバルバランス40V A < 適格機関投資家限定 >	73,691,382円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	8,737,379円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	7,741,901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 >	4,041,277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 >	21,448,701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 >	58,834,436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 >	130,885,825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 >	61,717,109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 >	617,208,199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>	107,877,816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>	49,785,224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>	30,625,590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>	26,421,298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>	33,774,984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>	71,402,336円
合 計	61,407,657,975円

(2023年2月20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	61,407,657,975円
同期中における追加設定元本額	24,447,125,618円
同期中における一部解約元本額	10,512,215,695円

## 2023年2月20日現在の元本の内訳

三井住友・D C 外国株式インデックスファンドS	37,413,562,738円
三井住友・D C 年金バランス3 0 (債券重点型)	295,274,961円
三井住友・D C 年金バランス5 0 (標準型)	1,115,344,973円
三井住友・D C 年金バランス7 0 (株式重点型)	815,354,615円
S M A M ・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	34,670,931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)	992,117円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 2 5 (4資産タイプ)	5,457,854円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 3 0 (4資産タイプ)	17,365,378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)	51,071,386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)	57,531,698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)	108,600,216円
外国株式指数ファンド	980,282,730円
三井住友・D C つみたてN I S A ・全海外株インデックスファンド	18,845,760,167円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	139,776,013円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	174,586,158円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	110,233,388円
イオン・バランス戦略ファンド	24,288,448円
三井住友D S ・D C ターゲットイヤーファンド2 0 5 0	23,707,090円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	140,014,851円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	125,293,120円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	467,911,037円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	254,195,375円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	292,755,170円
三井住友・D C つみたてN I S A ・世界分散ファンド	59,105,049円
三井住友D S ・外国株式インデックス年金ファンド	1,855,764,128円
三井住友D S ・年金バランス3 0 (債券重点型)	11,428,893円
三井住友D S ・年金バランス5 0 (標準型)	52,455,481円
三井住友D S ・年金バランス7 0 (株式重点型)	47,972,323円
三井住友D S ・D C ターゲットイヤーファンド2 0 6 0	3,087,533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)	534,084,201円
日興F W S ・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	317,177,107円
日興F W S ・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	1,706,143,742円

三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド	52,963,147円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	22,505円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	27,108円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	33,586円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	39,724円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	39,724円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	424,161,823円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	2,738,893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>	18,997,417円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	494,761,087円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	683,818,913円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	2,995,512,553円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	9,822,476円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	48,949,181円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	415,329,798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>	87,142,750円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	418,011,926円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	287,214,833円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	660,368,254円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	195,290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)	190,859,012円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	58,376,901円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	7,134,203円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	6,599,547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>	16,687,253円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	51,140,413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>	105,383,191円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	44,957,268円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	259,817,292円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	72,627,493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>	1,506,053,315円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	15,290,739円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	9,454,653円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	12,173,583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>	264,686,196円
合計	75,342,567,898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	
	APA CORP	19,759	38.090	752,620.31	

アメリカ・  
ドル

BAKER HUGHES CO	69,679	30.590	2,131,480.61
CHENIERE ENERGY INC	14,977	144.870	2,169,717.99
CHESAPEAKE ENERGY CORP	7,695	80.090	616,292.55
CHEVRON CORP	127,235	162.850	20,720,219.75
CONOCOPHILLIPS	86,690	104.120	9,026,162.80
COTERRA ENERGY INC	49,908	23.400	1,167,847.20
DEVON ENERGY CORP	44,032	53.330	2,348,226.56
DIAMONDBACK ENERGY INC	11,049	134.680	1,488,079.32
EOG RESOURCES INC	39,908	118.420	4,725,905.36
EQT CORP	19,298	31.250	603,062.50
EXXON MOBIL CORP	284,707	111.280	31,682,194.96
HALLIBURTON CO	59,461	36.500	2,170,326.50
HESS CORP	18,976	135.520	2,571,627.52
HF SINCLAIR CORP	10,663	52.300	557,674.90
KINDER MORGAN INC	138,727	17.730	2,459,629.71
MARATHON OIL CORP	42,380	25.860	1,095,946.80
MARATHON PETROLEUM CORP	33,955	122.500	4,159,487.50
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	65,062	60.730	3,951,215.26
ONEOK INC	31,946	67.260	2,148,687.96
OVINTIV INC	16,672	43.540	725,898.88
PHILLIPS 66	33,814	99.540	3,365,845.56
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	15,440	208.960	3,226,342.40
SCHLUMBERGER LTD	94,622	53.340	5,047,137.48
TARGA RESOURCES CORP	15,416	73.940	1,139,859.04
TEXAS PACIFIC LAND CORP	417	1,794.750	748,410.75
VALERO ENERGY CORP	27,588	129.610	3,575,680.68
WILLIAMS COS INC	82,707	31.260	2,585,420.82
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	15,122	279.710	4,229,774.62
ALBEMARLE CORP	8,338	258.010	2,151,287.38
ALCOA CORP	11,849	46.890	555,599.61
AMCOR PLC	97,610	11.420	1,114,706.20
AVERY DENNISON CORP	5,454	182.500	995,355.00
BALL CORP	19,410	57.540	1,116,851.40
CELANESE CORP	6,643	118.900	789,852.70
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	14,020	82.350	1,154,547.00
CLEVELAND-CLIFFS INC	33,403	19.820	662,047.46
CORTEVA INC	48,566	61.810	3,001,864.46
CROWN HOLDINGS INC	9,413	86.780	816,860.14
DOW INC	48,964	58.130	2,846,277.32
DUPONT DE NEMOURS INC	34,201	75.080	2,567,811.08
EASTMAN CHEMICAL CO	9,517	87.050	828,454.85
ECOLAB INC	18,131	162.410	2,944,655.71
FMC CORP	8,548	128.200	1,095,853.60
FREEMPORT-MCMORAN INC	99,638	41.740	4,158,890.12

INTERNATIONAL PAPER CO	23,472	38.270	898,273.44	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	17,659	96.500	1,704,093.50	
LINDE PLC	33,937	321.520	10,911,424.24	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	17,144	97.320	1,668,454.08	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,203	371.680	1,562,171.04	
MOSAIC CO/THE	21,306	49.850	1,062,104.10	
NEWMONT CORP	55,957	45.420	2,541,566.94	
NUCOR CORP	17,484	168.070	2,938,535.88	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,111	141.010	1,002,722.11	
PPG INDUSTRIES INC	15,181	129.910	1,972,163.71	
RPM INTERNATIONAL INC	7,696	88.070	677,786.72	
SEALED AIR CORP	7,895	50.260	396,802.70	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	17,193	227.980	3,919,660.14	
STEEL DYNAMICS INC	12,713	124.970	1,588,743.61	
VULCAN MATERIALS CO	8,762	185.650	1,626,665.30	
WESTLAKE CORP	2,189	122.510	268,174.39	
WESTROCK CO	16,766	32.550	545,733.30	
3M CO	37,053	112.990	4,186,618.47	
AERCAP HOLDINGS NV	10,065	61.380	617,789.70	
ALLEGION PLC	6,843	118.600	811,579.80	
AMETEK INC	14,928	146.490	2,186,802.72	
BOEING CO/THE	38,897	211.660	8,232,939.02	
CARLISLE COS INC	3,499	266.190	931,398.81	
CARRIER GLOBAL CORP	55,822	45.220	2,524,270.84	
CATERPILLAR INC	36,294	247.790	8,993,290.26	
CUMMINS INC	9,144	257.470	2,354,305.68	
DEERE & CO	20,015	433.310	8,672,699.65	
DOVER CORP	10,436	155.360	1,621,336.96	
EATON CORP PLC	26,694	175.240	4,677,856.56	
EMERSON ELECTRIC CO	39,768	85.440	3,397,777.92	
FASTENAL CO	37,051	53.440	1,980,005.44	
FERGUSON PLC	14,464	148.040	2,141,250.56	
FORTIVE CORP	21,981	69.360	1,524,602.16	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	7,166	64.350	461,132.10	
GENERAC HOLDINGS INC	3,973	126.770	503,657.21	
GENERAL DYNAMICS CORP	15,874	235.260	3,734,517.24	
GENERAL ELECTRIC CO	74,672	83.040	6,200,762.88	
HEICO CORP	3,085	176.900	545,736.50	
HEICO CORP-CLASS A	4,570	139.500	637,515.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	45,877	201.420	9,240,545.34	
HOWMET AEROSPACE INC	23,889	43.020	1,027,704.78	
HUBBELL INC	3,897	252.060	982,277.82	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,888	224.540	648,471.52	
IDEX CORP	4,788	231.000	1,106,028.00	

ILLINOIS TOOL WORKS	20,720	240.340	4,979,844.80	
INGERSOLL-RAND INC	29,314	57.580	1,687,900.12	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	11,600	51.520	597,632.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	46,593	64.710	3,015,033.03	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	12,963	214.020	2,774,341.26	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,104	269.370	566,754.48	
LOCKHEED MARTIN CORP	16,474	475.630	7,835,528.62	
MASCO CORP	14,885	55.030	819,121.55	
NORDSON CORP	3,927	246.220	966,905.94	
NORTHROP GRUMMAN CORP	10,242	470.630	4,820,192.46	
OTIS WORLDWIDE CORP	28,787	84.760	2,439,986.12	
OWENS CORNING	7,597	99.930	759,168.21	
PACCAR INC	36,912	75.690	2,793,869.28	
PARKER HANNIFIN CORP	8,744	355.480	3,108,317.12	
PENTAIR PLC	11,509	56.830	654,056.47	
PLUG POWER INC	28,584	15.580	445,338.72	
QUANTA SERVICES INC	10,416	154.900	1,613,438.40	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	100,547	101.510	10,206,525.97	
ROCKWELL AUTOMATION INC	7,930	297.720	2,360,919.60	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	12,538	52.170	654,107.46	
SMITH (A.O.) CORP	7,157	67.240	481,236.68	
SNAP-ON INC	4,041	252.280	1,019,463.48	
STANLEY BLACK & DECKER INC	9,129	89.180	814,124.22	
TEXTRON INC	14,870	74.810	1,112,424.70	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	15,733	184.180	2,897,703.94	
TRANSDIGM GROUP INC	3,374	743.970	2,510,154.78	
UNITED RENTALS INC	4,798	461.250	2,213,077.50	
WABTEC CORP	11,284	105.490	1,190,349.16	
WW GRAINGER INC	3,160	677.350	2,140,426.00	
XYLEM INC	12,201	107.290	1,309,045.29	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	8,029	96.920	778,170.68	
CINTAS CORP	6,178	444.100	2,743,649.80	
CLARIVATE PLC	19,939	10.710	213,546.69	
COPART INC	27,584	68.400	1,886,745.60	
COSTAR GROUP INC	28,273	77.560	2,192,853.88	
EQUIFAX INC	7,922	211.720	1,677,245.84	
JACOBS SOLUTIONS INC	8,422	121.890	1,026,557.58	
LEIDOS HOLDINGS INC	8,863	101.240	897,290.12	
REPUBLIC SERVICES INC	14,232	131.960	1,878,054.72	
ROBERT HALF INTL INC	8,149	82.420	671,640.58	
ROLLINS INC	16,081	36.300	583,740.30	
TRANSUNION	14,503	69.280	1,004,767.84	
VERISK ANALYTICS INC	11,250	177.130	1,992,712.50	
WASTE CONNECTIONS INC	18,291	136.110	2,489,588.01	



WASTE MANAGEMENT INC	28,817	154.920	4,464,329.64
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,726	101.170	882,809.42
CSX CORP	145,813	31.210	4,550,823.73
DELTA AIR LINES INC	8,299	38.360	318,349.64
EXPEDITORS INTL WASH INC	10,436	111.400	1,162,570.40
FEDEX CORP	16,733	210.300	3,518,949.90
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	96,661	3.480	336,380.28
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,530	188.350	1,041,575.50
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	12,089	60.120	726,790.68
NORFOLK SOUTHERN CORP	15,994	228.150	3,649,031.10
OLD DOMINION FREIGHT LINE	6,292	354.840	2,232,653.28
SOUTHWEST AIRLINES CO	7,076	35.360	250,207.36
UBER TECHNOLOGIES INC	104,406	34.770	3,630,196.62
U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING	5,850	57.370	335,614.50
UNION PACIFIC CORP	42,525	201.590	8,572,614.75
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	49,837	183.210	9,130,636.77
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	6,249	22.160	138,477.84
APTIV PLC	17,416	119.640	2,083,650.24
BORGWARNER INC	17,433	50.430	879,146.19
FORD MOTOR CO	276,446	12.890	3,563,388.94
GENERAL MOTORS CO	96,958	43.170	4,185,676.86
LEAR CORP	3,736	143.740	537,012.64
LUCID GROUP INC	21,730	10.930	237,508.90
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	19,354	20.220	391,337.88
TESLA INC	181,374	208.310	37,782,017.94
DR HORTON INC	23,515	94.380	2,219,345.70
GARMIN LTD	10,774	97.010	1,045,185.74
HASBRO INC	7,491	59.360	444,665.76
LENNAR CORP-A	17,126	99.090	1,697,015.34
LULULEMON ATHLETICA INC	7,619	320.360	2,440,822.84
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	113.930	326,181.59
NEWELL BRANDS INC	26,997	14.900	402,255.30
NIKE INC -CL B	86,051	124.840	10,742,606.84
NVR INC	204	5,098.140	1,040,020.56
PULTEGROUP INC	17,535	54.300	952,150.50
VF CORP	20,583	26.990	555,535.17
WHIRLPOOL CORP	3,212	145.000	465,740.00
AIRBNB INC-CLASS A	25,852	131.600	3,402,123.20
ARAMARK	13,242	38.300	507,168.60
BOOKING HOLDINGS INC	2,746	2,462.010	6,760,679.46
CAESARS ENTERTAINMENT INC	13,336	52.800	704,140.80
CARNIVAL CORP	69,745	11.290	787,421.05
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,953	1,617.670	3,159,309.51
DARDEN RESTAURANTS INC	7,606	146.090	1,111,160.54

DOMINO'S PIZZA INC	2,121	357.360	757,960.56	
EXPEDIA GROUP INC	10,081	108.960	1,098,425.76	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	19,380	146.340	2,836,069.20	
LAS VEGAS SANDS CORP	23,449	56.020	1,313,612.98	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	18,185	172.520	3,137,276.20	
MCDONALD'S CORP	50,100	269.990	13,526,499.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,198	43.560	966,944.88	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,097	73.030	1,175,563.91	
STARBUCKS CORP	79,076	107.100	8,469,039.60	
VAIL RESORTS INC	2,860	243.340	695,952.40	
WYNN RESORTS LTD	7,730	109.010	842,647.30	
YUM! BRANDS INC	20,179	132.040	2,664,435.16	
ADVANCE AUTO PARTS INC	3,426	149.990	513,865.74	
AMAZON.COM INC	625,241	97.200	60,773,425.20	
AUTOZONE INC	1,315	2,605.620	3,426,390.30	
BATH & BODY WORKS INC	15,400	42.890	660,506.00	
BEST BUY CO INC	14,954	86.940	1,300,100.76	
BURLINGTON STORES INC	4,802	227.940	1,094,567.88	
CARMAX INC	10,366	72.950	756,199.70	
CHEWY INC - CLASS A	3,969	44.610	177,057.09	
DOLLAR GENERAL CORP	15,800	227.820	3,599,556.00	
DOLLAR TREE INC	15,923	148.040	2,357,240.92	
DOORDASH INC - A	16,981	61.810	1,049,595.61	
EBAY INC	35,551	48.240	1,714,980.24	
ETSY INC	9,090	129.680	1,178,791.20	
GENUINE PARTS CO	10,245	180.140	1,845,534.30	
HOME DEPOT INC	69,713	317.950	22,165,248.35	
LKQ CORP	15,922	58.840	936,850.48	
LOWE'S COS INC	42,268	212.750	8,992,517.00	
MERCADOLIBRE INC	3,170	1,100.870	3,489,757.90	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,265	873.010	3,723,387.65	
POOL CORP	2,578	376.580	970,823.24	
ROSS STORES INC	24,702	115.690	2,857,774.38	
TARGET CORP	30,746	173.220	5,325,822.12	
TJX COMPANIES INC	80,320	79.830	6,411,945.60	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,072	239.000	1,690,208.00	
ULTA BEAUTY INC	3,287	530.000	1,742,110.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	30,165	507.480	15,308,134.20	
KROGER CO	44,568	44.000	1,960,992.00	
SYSCO CORP	33,182	78.710	2,611,755.22	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	52,808	36.760	1,941,222.08	
WALMART INC	103,381	146.440	15,139,113.64	
ALTRIA GROUP INC	122,631	48.070	5,894,872.17	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	39,414	81.590	3,215,788.26	

BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	22,643	65.650	1,486,512.95	
BUNGE LTD	10,263	97.570	1,001,360.91	
CAMPBELL SOUP CO	12,945	52.350	677,670.75	
COCA-COLA CO/THE	280,260	60.120	16,849,231.20	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	13,260	56.230	745,609.80	
CONAGRA BRANDS INC	30,896	36.410	1,124,923.36	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	10,439	226.800	2,367,565.20	
DARLING INGREDIENTS INC	10,514	66.550	699,706.70	
GENERAL MILLS INC	39,056	76.770	2,998,329.12	
HERSHEY CO/THE	10,035	240.690	2,415,324.15	
HORMEL FOODS CORP	19,475	45.740	890,786.50	
JM SMUCKER CO/THE	6,647	149.940	996,651.18	
KELLOGG CO	15,843	68.380	1,083,344.34	
KEURIG DR PEPPER INC	53,534	35.670	1,909,557.78	
KRAFT HEINZ CO/THE	48,205	40.000	1,928,200.00	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	10,534	100.480	1,058,456.32	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,425	75.750	1,395,693.75	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	12,477	52.020	649,053.54	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	93,332	66.850	6,239,244.20	
MONSTER BEVERAGE CORP	26,021	104.180	2,710,867.78	
PEPSICO INC	94,583	176.280	16,673,091.24	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	105,562	101.820	10,748,322.84	
TYSON FOODS INC-CL A	19,731	61.370	1,210,891.47	
CHURCH & DWIGHT CO INC	17,113	83.780	1,433,727.14	
CLOROX COMPANY	9,104	153.630	1,398,647.52	
COLGATE-PALMOLIVE CO	55,341	74.520	4,124,011.32	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	15,603	252.880	3,945,686.64	
KIMBERLY-CLARK CORP	22,991	127.230	2,925,144.93	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	162,446	140.010	22,744,064.46	
ABBOTT LABORATORIES	119,254	106.740	12,729,171.96	
ALIGN TECHNOLOGY INC	4,914	316.710	1,556,312.94	
AMERISOURCEBERGEN CORP	10,249	161.490	1,655,111.01	
BAXTER INTERNATIONAL INC	33,018	41.000	1,353,738.00	
BECTON DICKINSON AND CO	19,828	244.520	4,848,342.56	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	99,665	46.540	4,638,409.10	
CARDINAL HEALTH INC	18,000	78.780	1,418,040.00	
CENTENE CORP	40,300	73.360	2,956,408.00	
CIGNA CORP	21,108	301.060	6,354,774.48	
COOPER COS INC/THE	3,384	345.120	1,167,886.08	
CVS HEALTH CORP	89,400	88.580	7,919,052.00	
DAVITA INC	4,138	83.930	347,302.34	
DENTSPLY SIRONA INC	11,864	35.840	425,205.76	
DEXCOM INC	27,694	114.760	3,178,163.44	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	40,645	78.510	3,191,038.95	

ELEVANCE HEALTH INC	16,551	495.040	8,193,407.04	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	23,573	73.170	1,724,836.41	
HCA HEALTHCARE INC	16,032	262.840	4,213,850.88	
HENRY SCHEIN INC	10,457	83.140	869,394.98	
HOLOGIC INC	16,591	82.730	1,372,573.43	
HUMANA INC	8,820	510.140	4,499,434.80	
IDEXX LABORATORIES INC	5,548	496.460	2,754,360.08	
INSULET CORP	5,082	296.000	1,504,272.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	24,730	238.910	5,908,244.30	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	6,245	256.260	1,600,343.70	
MASIMO CORP	2,941	164.750	484,529.75	
MCKESSON CORP	10,067	366.860	3,693,179.62	
MEDTRONIC PLC	91,754	84.800	7,780,739.20	
MOLINA HEALTHCARE INC	3,809	296.070	1,127,730.63	
NOVOCURE LTD	6,929	84.740	587,163.46	
QUEST DIAGNOSTICS INC	7,645	148.220	1,133,141.90	
RESMED INC	9,600	216.140	2,074,944.00	
STERIS PLC	6,271	189.660	1,189,357.86	
STRYKER CORP	23,557	263.160	6,199,260.12	
TELEFLEX INC	3,067	247.470	758,990.49	
UNITEDHEALTH GROUP INC	63,697	499.080	31,789,898.76	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,203	150.750	633,602.25	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	9,184	170.490	1,565,780.16	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	13,599	125.970	1,713,066.03	
ABBVIE INC	121,109	151.310	18,325,002.79	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	19,556	148.260	2,899,372.56	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,912	222.790	1,762,714.48	
AMGEN INC	36,847	240.530	8,862,808.91	
AVANTOR INC	44,191	24.540	1,084,447.14	
BIOGEN INC	9,574	278.380	2,665,210.12	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	11,557	108.310	1,251,738.67	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,728	483.230	835,021.44	
BIO-TECHNE CORP	10,204	75.960	775,095.84	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	145,406	71.110	10,339,820.66	
CATALENT INC	10,797	71.370	770,581.89	
CHARLES RIVER LABORATORIES	3,467	249.760	865,917.92	
DANAHER CORP	47,447	256.290	12,160,191.63	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	20,811	13.130	273,248.43	
ELI LILLY & CO	54,999	328.400	18,061,671.60	
EXACT SCIENCES CORP	13,570	63.480	861,423.60	
GILEAD SCIENCES INC	86,583	84.760	7,338,775.08	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	13,945	109.930	1,532,973.85	
ILLUMINA INC	10,327	211.830	2,187,568.41	
INCYTE CORP	11,842	79.000	935,518.00	

IQVIA HOLDINGS INC	12,401	219.730	2,724,871.73	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,089	147.730	604,067.97	
JOHNSON & JOHNSON	179,040	160.390	28,716,225.60	
MERCK & CO. INC.	172,510	109.520	18,893,295.20	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,476	1,513.930	2,234,560.68	
MODERNA INC	21,941	166.600	3,655,370.60	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,359	103.540	658,410.86	
PERKINELMER INC	8,323	133.440	1,110,621.12	
PFIZER INC	384,212	43.210	16,601,800.52	
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,436	748.740	5,567,630.64	
REPLIGEN CORP	3,456	190.000	656,640.00	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	20,785	37.840	786,504.40	
SEAGEN INC	8,954	162.530	1,455,293.62	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	73,873	10.060	743,162.38	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	26,680	559.700	14,932,796.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	17,790	293.660	5,224,211.40	
VIATRIS INC	83,466	11.690	975,717.54	
WATERS CORP	4,095	328.730	1,346,149.35	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,276	313.720	1,655,186.72	
ZOETIS INC	32,496	172.030	5,590,286.88	
BANK OF AMERICA CORP	492,461	35.350	17,408,496.35	
CITIGROUP INC	133,869	51.420	6,883,543.98	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	36,122	43.180	1,559,747.96	
FIFTH THIRD BANCORP	49,541	36.950	1,830,539.95	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	670	761.500	510,205.00	
FIRST HORIZON CORP	39,014	24.840	969,107.76	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	11,979	128.890	1,543,973.31	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	105,007	15.400	1,617,107.80	
JPMORGAN CHASE & CO	199,966	142.240	28,443,163.84	
KEYCORP	62,741	19.150	1,201,490.15	
M & T BANK CORP	12,629	159.920	2,019,629.68	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	27,928	158.590	4,429,101.52	
REGIONS FINANCIAL CORP	62,979	23.860	1,502,678.94	
SIGNATURE BANK	4,335	124.310	538,883.85	
SVB FINANCIAL GROUP	3,727	292.790	1,091,228.33	
TRUIST FINANCIAL CORP	92,408	48.490	4,480,863.92	
US BANCORP	96,119	48.600	4,671,383.40	
WEBSTER FINANCIAL CORP	9,600	54.970	527,712.00	
WELLS FARGO & CO	258,297	47.490	12,266,524.53	
ALLY FINANCIAL INC	20,139	31.050	625,315.95	
AMERICAN EXPRESS CO	43,398	177.300	7,694,465.40	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,131	351.480	2,506,403.88	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	27,656	71.440	1,975,744.64	
ARES MANAGEMENT CORP - A	11,370	83.110	944,960.70	

BANK OF NEW YORK MELLON CORP	54,315	51.500	2,797,222.50	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	88,937	308.240	27,413,940.88	
BLACKROCK INC	10,403	716.160	7,450,212.48	
BLACKSTONE INC	47,782	93.520	4,468,572.64	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	27,026	111.170	3,004,480.42	
CARLYLE GROUP INC/THE	10,094	35.040	353,693.76	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	7,323	129.090	945,326.07	
CME GROUP INC	25,066	188.640	4,728,450.24	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	7,252	65.200	472,830.40	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	18,645	111.180	2,072,951.10	
EQUITABLE HOLDINGS INC	22,820	32.750	747,355.00	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,377	431.230	1,025,033.71	
FRANKLIN RESOURCES INC	21,778	31.330	682,304.74	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	5,375	47.310	254,291.25	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	23,245	368.500	8,565,782.50	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	38,979	107.110	4,175,040.69	
INVESCO LTD	18,328	18.710	342,916.88	
KKR & CO INC	37,308	57.180	2,133,271.44	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	4,992	249.990	1,247,950.08	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,653	355.170	942,266.01	
MOODY'S CORP	11,246	301.450	3,390,106.70	
MORGAN STANLEY	88,738	99.510	8,830,318.38	
MSCI INC	5,669	544.830	3,088,641.27	
NASDAQ INC	22,924	58.560	1,342,429.44	
NORTHERN TRUST CORP	13,026	96.710	1,259,744.46	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	12,735	112.170	1,428,484.95	
S&P GLOBAL INC	23,475	360.830	8,470,484.25	
SCHWAB (CHARLES) CORP	100,352	80.320	8,060,272.64	
SEI INVESTMENTS COMPANY	7,550	61.400	463,570.00	
STATE STREET CORP	24,045	92.000	2,212,140.00	
SYNCHRONY FINANCIAL	32,112	35.770	1,148,646.24	
T ROWE PRICE GROUP INC	14,797	118.730	1,756,847.81	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	8,688	72.570	630,488.16	
AFLAC INC	40,880	69.370	2,835,845.60	
ALLSTATE CORP	18,070	135.050	2,440,353.50	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,866	133.800	651,070.80	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	50,566	60.820	3,075,424.12	
AON PLC-CLASS A	14,138	310.270	4,386,597.26	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	25,320	67.810	1,716,949.20	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,270	188.600	2,691,322.00	
ASSURANT INC	3,114	132.410	412,324.74	
BROWN & BROWN INC	14,273	57.670	823,123.91	
CHUBB LTD	28,440	210.610	5,989,748.40	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,510	127.030	1,335,085.30	

ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,288	241.690	311,296.72	
EVEREST RE GROUP LTD	2,755	386.750	1,065,496.25	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	19,058	42.950	818,541.10	
GLOBE LIFE INC	6,373	122.930	783,432.89	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	21,767	78.450	1,707,621.15	
LINCOLN NATIONAL CORP	8,677	33.820	293,456.14	
LOEWS CORP	12,727	61.510	782,837.77	
MARKEL CORP	837	1,326.570	1,110,339.09	
MARSH & MCLENNAN COS	33,277	166.440	5,538,623.88	
METLIFE INC	47,592	72.540	3,452,323.68	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	16,409	91.030	1,493,711.27	
PROGRESSIVE CORP	39,066	141.520	5,528,620.32	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	24,389	101.530	2,476,215.17	
TRAVELERS COS INC/THE	16,719	185.750	3,105,554.25	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	7,897	240.890	1,902,308.33	
WR BERKLEY CORP	14,486	67.140	972,590.04	
CBRE GROUP INC - A	20,793	88.760	1,845,586.68	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	79,100	4.700	371,770.00	
ZILLOW GROUP INC - C	10,672	45.890	489,738.08	
ACCENTURE PLC-CL A	43,075	277.050	11,933,928.75	
ADOBE INC	32,139	356.850	11,468,802.15	
AFFIRM HOLDINGS INC	9,077	12.980	117,819.46	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	10,300	77.300	796,190.00	
ANSYS INC	5,908	270.760	1,599,650.08	
ASPEN TECHNOLOGY INC	1,901	213.950	406,718.95	
AUTODESK INC	14,728	219.980	3,239,865.44	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	28,752	228.695	6,575,438.64	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	11,682	40.890	477,676.98	
BILL.COM HOLDINGS INC	6,004	93.300	560,173.20	
BLACK KNIGHT INC	10,656	63.940	681,344.64	
BLOCK INC	34,717	75.020	2,604,469.34	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	7,244	143.860	1,042,121.84	
CADENCE DESIGN SYS INC	19,198	194.440	3,732,859.12	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,485	74.960	785,955.60	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	6,776	124.960	846,728.96	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	19,210	64.450	1,238,084.50	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	36,763	65.480	2,407,241.24	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	13,021	114.250	1,487,649.25	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,173	146.130	463,670.49	
DATADOG INC - CLASS A	16,206	79.990	1,296,317.94	
DOCUSIGN INC	12,031	64.470	775,638.57	
DROPBOX INC-CLASS A	16,584	21.220	351,912.48	
DYNATRACE INC	15,753	42.710	672,810.63	
EPAM SYSTEMS INC	3,733	338.210	1,262,537.93	

FAIR ISAAC CORP	1,871	682.190	1,276,377.49	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	42,749	69.500	2,971,055.50	
FISERV INC	42,333	115.370	4,883,958.21	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,371	213.580	933,558.18	
FORTINET INC	43,392	60.640	2,631,290.88	
GARTNER INC	5,357	346.020	1,853,629.14	
GEN DIGITAL INC	41,779	21.040	879,030.16	
GLOBAL PAYMENTS INC	18,157	116.310	2,111,840.67	
GODADDY INC - CLASS A	11,895	77.810	925,549.95	
HUBSPOT INC	3,318	404.650	1,342,628.70	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	62,270	135.020	8,407,695.40	
INTUIT INC	18,486	404.380	7,475,368.68	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,971	169.000	840,099.00	
MASTERCARD INC - A	58,755	361.130	21,218,193.15	
MICROSOFT CORP	482,470	258.060	124,506,208.20	
MONGODB INC	4,150	213.130	884,489.50	
OKTA INC	10,337	74.010	765,041.37	
ORACLE CORP	110,034	87.280	9,603,767.52	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	98,735	9.200	908,362.00	
PALO ALTO NETWORKS INC	20,147	169.280	3,410,484.16	
PAYCHEX INC	22,937	114.750	2,632,020.75	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,778	303.890	1,148,096.42	
PAYLOCITY HOLDING CORP	2,718	209.310	568,904.58	
PAYPAL HOLDINGS INC	76,064	74.660	5,678,938.24	
PTC INC	7,295	130.290	950,465.55	
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,457	427.680	3,189,209.76	
SALESFORCE INC	68,700	165.170	11,347,179.00	
SERVICENOW INC	13,974	439.010	6,134,725.74	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	14,743	154.080	2,271,601.44	
SPLUNK INC	9,792	105.000	1,028,160.00	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	14,487	61.740	894,427.38	
SYNOPSIS INC	10,312	354.450	3,655,088.40	
TOAST INC-CLASS A	21,393	19.480	416,735.64	
TWILIO INC - A	10,905	70.670	770,656.35	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,139	343.600	1,078,560.40	
UNITY SOFTWARE INC	19,066	39.670	756,348.22	
VERISIGN INC	6,425	204.710	1,315,261.75	
VISA INC-CLASS A SHARES	111,340	223.560	24,891,170.40	
VMWARE INC-CLASS A	13,809	116.150	1,603,915.35	
WESTERN UNION CO	21,840	13.830	302,047.20	
WIX.COM LTD	4,119	85.400	351,762.60	
WORKDAY INC-CLASS A	13,178	185.800	2,448,472.40	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	13,927	76.110	1,059,983.97	
ZSCALER INC	6,271	132.350	829,966.85	



AMPHENOL CORP-CL A	41,781	81.030	3,385,514.43	
APPLE INC	1,095,092	152.550	167,056,284.60	
ARISTA NETWORKS INC	16,665	138.230	2,303,602.95	
ARROW ELECTRONICS INC	4,130	123.280	509,146.40	
CDW CORP/DE	8,621	213.930	1,844,290.53	
CISCO SYSTEMS INC	281,989	50.770	14,316,581.53	
COGNEX CORP	11,368	48.140	547,255.52	
CORNING INC	51,762	35.580	1,841,691.96	
DELL TECHNOLOGIES -C	18,797	42.480	798,496.56	
F5 INC	3,921	146.880	575,916.48	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	86,138	16.360	1,409,217.68	
HP INC	69,711	30.160	2,102,483.76	
JUNIPER NETWORKS INC	21,151	31.560	667,525.56	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	11,811	185.780	2,194,247.58	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	11,763	269.420	3,169,187.46	
NETAPP INC	13,273	67.410	894,732.93	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	11,800	70.260	829,068.00	
TE CONNECTIVITY LTD	20,969	131.850	2,764,762.65	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,432	438.950	1,506,476.40	
TRIMBLE INC	15,566	55.200	859,243.20	
WESTERN DIGITAL CORP	18,492	41.580	768,897.36	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	3,257	322.580	1,050,643.06	
ADVANCED MICRO DEVICES	111,153	78.500	8,725,510.50	
ANALOG DEVICES INC	35,611	192.710	6,862,595.81	
APPLIED MATERIALS INC	59,454	115.440	6,863,369.76	
BROADCOM INC	27,499	595.590	16,378,129.41	
ENPHASE ENERGY INC	8,881	204.990	1,820,516.19	
ENTEGRIS INC	9,961	85.480	851,466.28	
FIRST SOLAR INC	6,859	164.280	1,126,796.52	
INTEL CORP	283,167	27.610	7,818,240.87	
KLA CORP	9,474	387.920	3,675,154.08	
LAM RESEARCH CORP	9,194	495.660	4,557,098.04	
MARVELL TECHNOLOGY INC	60,303	44.140	2,661,774.42	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	36,442	83.270	3,034,525.34	
MICRON TECHNOLOGY INC	76,774	59.010	4,530,433.74	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,887	502.090	1,449,533.83	
NVIDIA CORP	169,563	213.880	36,266,134.44	
NXP SEMICONDUCTORS NV	18,416	188.460	3,470,679.36	
ON SEMICONDUCTOR	27,891	81.860	2,283,157.26	
QORVO INC	6,042	103.080	622,809.36	
QUALCOMM INC	77,221	127.720	9,862,666.12	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	10,677	115.835	1,236,770.29	
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	4,104	305.040	1,251,884.16	
TERADYNE INC	10,642	105.250	1,120,070.50	

TEXAS INSTRUMENTS INC	62,613	175.320	10,977,311.16	
WOLFSPEED INC	8,461	77.630	656,827.43	
AT&T INC	490,389	19.440	9,533,162.16	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	21,079	21.430	451,722.97	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	8,432	20.940	176,566.08	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	49,758	3.930	195,548.94	
T-MOBILE US INC	43,384	149.350	6,479,400.40	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	288,471	40.220	11,602,303.62	
AES CORP	41,893	26.230	1,098,853.39	
ALLIANT ENERGY CORP	16,641	53.970	898,114.77	
AMEREN CORPORATION	16,937	87.260	1,477,922.62	
AMERICAN ELECTRIC POWER	34,672	92.410	3,204,039.52	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,721	149.610	1,753,578.81	
ATMOS ENERGY CORP	8,726	117.110	1,021,901.86	
CENTERPOINT ENERGY INC	44,329	29.210	1,294,850.09	
CMS ENERGY CORP	20,578	61.970	1,275,218.66	
CONSOLIDATED EDISON INC	25,230	93.250	2,352,697.50	
CONSTELLATION ENERGY	22,424	84.550	1,895,949.20	
DOMINION ENERGY INC	56,137	58.700	3,295,241.90	
DTE ENERGY COMPANY	14,083	115.300	1,623,769.90	
DUKE ENERGY CORP	53,442	99.490	5,316,944.58	
EDISON INTERNATIONAL	24,655	67.590	1,666,431.45	
ENTERGY CORP	14,800	109.430	1,619,564.00	
ESSENTIAL UTILITIES INC	16,329	46.150	753,583.35	
EVERGY INC	17,275	62.100	1,072,777.50	
EVERSOURCE ENERGY	22,116	80.270	1,775,251.32	
EXELON CORP	69,982	43.050	3,012,725.10	
FIRSTENERGY CORP	37,970	41.030	1,557,909.10	
NEXTERA ENERGY INC	135,130	76.070	10,279,339.10	
NISOURCE INC	25,829	27.140	700,999.06	
NRG ENERGY INC	13,547	34.220	463,578.34	
P G & E CORP	108,132	15.570	1,683,615.24	
PPL CORP	47,199	28.810	1,359,803.19	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	33,085	62.230	2,058,879.55	
SEMPRA ENERGY	20,814	158.490	3,298,810.86	
SOUTHERN CO/THE	72,781	66.630	4,849,398.03	
UGI CORP	15,256	39.150	597,272.40	
VISTRA CORP	25,777	22.960	591,839.92	
WEC ENERGY GROUP INC	22,571	92.870	2,096,168.77	
XCEL ENERGY INC	37,222	68.010	2,531,468.22	
ACTIVISION BLIZZARD INC	54,622	77.570	4,237,028.54	
ALPHABET INC-CL A	409,023	94.350	38,591,320.05	
ALPHABET INC-CL C	377,716	94.590	35,728,156.44	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,918	395.620	3,132,519.16	

	COMCAST CORP-CLASS A	302,475	39.120	11,832,822.00	
	DISH NETWORK CORP-A	12,937	14.150	183,058.55	
	ELECTRONIC ARTS INC	18,378	112.000	2,058,336.00	
	FOX CORP - CLASS A	23,886	37.030	884,498.58	
	FOX CORP - CLASS B	8,773	34.220	300,212.06	
	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	26,027	37.360	972,368.72	
	LIBERTY BROADBAND-C	8,196	92.420	757,474.32	
	LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	13,438	70.010	940,794.38	
	LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	4,141	33.860	140,214.26	
	LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	12,383	33.840	419,040.72	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	11,080	76.390	846,401.20	
	MATCH GROUP INC	17,799	43.630	776,570.37	
	META PLATFORMS INC-CLASS A	155,983	172.880	26,966,341.04	
	NETFLIX INC	30,569	347.960	10,636,789.24	
	NEWS CORP - CLASS A	23,102	19.000	438,938.00	
	OMNICOM GROUP	12,545	93.720	1,175,717.40	
	PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	40,964	23.690	970,437.16	
	PINTEREST INC- CLASS A	38,300	24.430	935,669.00	
	ROBLOX CORP -CLASS A	22,745	40.880	929,815.60	
	ROKU INC	9,945	71.560	711,664.20	
	SEA LTD-ADR	24,719	65.010	1,606,982.19	
	SIRIUS XM HOLDINGS INC	56,550	4.600	260,130.00	
	SNAP INC - A	64,099	10.360	664,065.64	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	10,772	112.510	1,211,957.72	
	TRADE DESK INC/THE -CLASS A	28,906	60.300	1,743,031.80	
	WALT DISNEY CO/THE	125,092	105.220	13,162,180.24	
	WARNER BROS DISCOVERY INC	151,200	15.430	2,333,016.00	
	ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	15,382	25.710	395,471.22	
	アメリカ・ドル小計	23,116,993		2,403,076,796.17 (323,093,675,245)	
カナダ・ドル	ARC RESOURCES LTD	44,923	14.730	661,715.79	
	CAMECO CORP	26,627	38.780	1,032,595.06	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	77,007	75.050	5,779,375.35	
	CENOVUS ENERGY INC	99,824	24.510	2,446,686.24	
	ENBRIDGE INC	140,420	52.380	7,355,199.60	
	IMPERIAL OIL LTD	16,267	67.570	1,099,161.19	
	KEYERA CORP	11,374	31.090	353,617.66	
	PARKLAND CORP	7,666	30.200	231,513.20	
	PEMBINA PIPELINE CORP	37,348	45.760	1,709,044.48	
	SUNCOR ENERGY INC	91,066	44.590	4,060,632.94	
	TC ENERGY CORP	68,290	56.840	3,881,603.60	
	TOURMALINE OIL CORP	20,401	58.960	1,202,842.96	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	31,873	62.310	1,986,006.63	
	BARRICK GOLD CORP	114,792	22.570	2,590,855.44	

CCL INDUSTRIES INC - CL B	8,705	61.630	536,489.15
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	41,452	26.570	1,101,379.64
FRANCO-NEVADA CORP	12,789	178.500	2,282,836.50
IVANHOE MINES LTD-CL A	32,698	12.510	409,051.98
KINROSS GOLD CORP	110,156	5.200	572,811.20
LUNDIN MINING CORP	46,446	8.820	409,653.72
NUTRIEN LTD	37,841	100.700	3,810,588.70
PAN AMERICAN SILVER CORP	11,763	21.830	256,786.29
TECK RESOURCES LTD-CLS B	34,947	59.400	2,075,851.80
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,438	104.990	465,945.62
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	31,091	56.970	1,771,254.27
CAE INC	17,963	31.440	564,756.72
TOROMONT INDUSTRIES LTD	6,027	112.500	678,037.50
WSP GLOBAL INC	9,260	172.390	1,596,331.40
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	9,913	41.770	414,066.01
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	7,930	84.360	668,974.80
THOMSON REUTERS CORP	11,370	166.030	1,887,761.10
AIR CANADA	12,083	21.200	256,159.60
CANADIAN NATL RAILWAY CO	40,874	157.220	6,426,210.28
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	62,138	104.580	6,498,392.04
TFI INTERNATIONAL INC	5,097	169.630	864,604.11
MAGNA INTERNATIONAL INC	18,921	76.280	1,443,293.88
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,082	120.000	369,840.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	11,302	40.180	454,114.36
RESTAURANT BRANDS INTERN	19,270	90.990	1,753,377.30
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	3,001	174.640	524,094.64
DOLLARAMA INC	20,468	79.920	1,635,802.56
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	57,969	65.590	3,802,186.71
EMPIRE CO LTD 'A'	9,148	36.850	337,103.80
LOBLAW COMPANIES LTD	11,573	118.890	1,375,913.97
METRO INC/CN	14,765	71.900	1,061,603.50
WESTON (GEORGE) LTD	4,984	169.610	845,336.24
SAPUTO INC	18,270	36.700	670,509.00
BANK OF MONTREAL	45,002	135.180	6,083,370.36
BANK OF NOVA SCOTIA	83,370	72.950	6,081,841.50
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	58,941	62.520	3,684,991.32
NATIONAL BANK OF CANADA	22,533	101.500	2,287,099.50
ROYAL BANK OF CANADA	94,772	138.790	13,153,405.88
TORONTO-DOMINION BANK	124,589	92.870	11,570,580.43
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	23,555	47.280	1,113,680.40
BROOKFIELD CORP	94,219	48.260	4,547,008.94
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	32,674	19.540	638,449.96
IGM FINANCIAL INC	4,949	42.810	211,866.69
ONEX CORPORATION	4,217	67.460	284,478.82

TMX GROUP LTD	3,142	135.560	425,929.52	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,393	932.700	1,299,251.10	
GREAT-WEST LIFECO INC	22,964	36.520	838,645.28	
IA FINANCIAL CORP INC	8,268	89.340	738,663.12	
INTACT FINANCIAL CORP	11,416	202.700	2,314,023.20	
MANULIFE FINANCIAL CORP	134,995	27.070	3,654,314.65	
POWER CORP OF CANADA	41,436	36.100	1,495,839.60	
SUN LIFE FINANCIAL INC	41,957	68.910	2,891,256.87	
FIRSTSERVICE CORP	2,516	191.280	481,260.48	
CGI INC	13,476	125.800	1,695,280.80	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,338	2,370.610	3,171,876.18	
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,424	101.290	650,686.96	
LUMINE GROUP INC	4,014	16.312	65,476.36	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	5,042	44.200	222,856.40	
OPEN TEXT CORP	21,507	47.430	1,020,077.01	
SHOPIFY INC - CLASS A	80,264	58.700	4,711,496.80	
BCE INC	5,509	61.780	340,346.02	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	25,321	66.170	1,675,490.57	
TELUS CORP	15,222	27.790	423,019.38	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	44,154	10.550	465,824.70	
ALTAGAS LTD	17,347	24.160	419,103.52	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	6,336	40.470	256,417.92	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	7,344	36.490	267,982.56	
EMERA INC	18,000	54.770	985,860.00	
FORTIS INC	35,086	55.740	1,955,693.64	
HYDRO ONE LTD	24,747	36.130	894,109.11	
NORTHLAND POWER INC	15,741	33.470	526,851.27	
QUEBECOR INC -CL B	14,578	32.620	475,534.36	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	34,743	39.250	1,363,662.75	
カナダ・ドル小計	2,788,713		167,595,572.46 (16,700,898,796)	
オーストラ リア・ドル	AMPOL LTD	14,428	31.770	458,377.56
	SANTOS LTD	213,811	6.850	1,464,605.35
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,722	29.150	370,846.30
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	132,981	34.510	4,589,174.31
	BHP GROUP LTD	344,969	48.000	16,558,512.00
	BLUESCOPE STEEL LTD	37,214	19.820	737,581.48
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	121,817	22.260	2,711,646.42
	IGO LTD	54,323	13.540	735,533.42
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	26,108	32.470	847,726.76
	MINERAL RESOURCES LTD	11,662	85.070	992,086.34
	NEWCREST MINING LTD	54,082	23.570	1,274,712.74
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	65,844	11.390	749,963.16
	ORICA LTD	36,212	16.060	581,564.72

PILBARA MINERALS LTD	197,160	4.440	875,390.40	
RIO TINTO LTD	25,693	124.260	3,192,612.18	
SOUTH32 LTD	276,348	4.530	1,251,856.44	
REECE LTD	13,059	16.980	221,741.82	
BRAMBLES LTD	86,089	12.130	1,044,259.57	
AURIZON HOLDINGS LTD	130,251	3.420	445,458.42	
QANTAS AIRWAYS LTD	78,226	6.600	516,291.60	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	43,243	35.500	1,535,126.50	
IDP EDUCATION LTD	15,855	30.720	487,065.60	
LOTTERY CORP LTD/THE	139,785	4.820	673,763.70	
WESFARMERS LTD	78,698	51.090	4,020,680.82	
COLES GROUP LTD	84,799	18.240	1,546,733.76	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	106,589	6.780	722,673.42	
WOOLWORTHS GROUP LTD	83,181	36.690	3,051,910.89	
TREASURY WINE ESTATES LTD	45,684	13.720	626,784.48	
COCHLEAR LTD	4,095	224.990	921,334.05	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	10,781	66.760	719,739.56	
SONIC HEALTHCARE LTD	31,126	33.450	1,041,164.70	
CSL LTD	33,279	298.400	9,930,453.60	
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	209,348	24.670	5,164,615.16	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	117,061	100.970	11,819,649.17	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	220,259	29.850	6,574,731.15	
WESTPAC BANKING CORP	244,569	22.780	5,571,281.82	
ASX LTD	11,180	67.970	759,904.60	
MACQUARIE GROUP LTD	24,071	189.000	4,549,419.00	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	173,755	4.830	839,236.65	
MEDIBANK PRIVATE LTD	128,724	3.120	401,618.88	
QBE INSURANCE GROUP LTD	101,860	14.390	1,465,765.40	
SUNCORP GROUP LTD	88,234	12.780	1,127,630.52	
COMPUTERSHARE LTD	33,381	23.880	797,138.28	
WISETECH GLOBAL LTD	10,621	56.540	600,511.34	
XERO LTD	8,683	77.760	675,190.08	
TELSTRA GROUP LTD	273,343	4.210	1,150,774.03	
ORIGIN ENERGY LTD	134,865	7.000	944,055.00	
REA GROUP LTD	2,833	126.430	358,176.19	
SEEK LTD	21,957	24.780	544,094.46	
オーストラリア・ドル小計	4,414,858		108,241,163.80 (9,993,906,654)	
香港・ドル				
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	173,424	47.800	8,289,667.20	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	101,000	100.800	10,180,800.00	
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	94,000	15.600	1,466,400.00	
MTR CORP	118,500	40.100	4,751,850.00	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	70,000	16.780	1,174,600.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	149,000	52.200	7,777,800.00	

	SANDS CHINA LTD	142,400	28.150	4,008,560.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	147,000	23.300	3,425,100.00	
	WH GROUP LTD	561,000	4.680	2,625,480.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	247,000	26.250	6,483,750.00	
	HANG SENG BANK LTD	48,200	123.300	5,943,060.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	79,000	330.800	26,133,200.00	
	AIA GROUP LTD	819,000	83.650	68,509,350.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	126,924	49.900	6,333,507.60	
	ESR GROUP LTD	157,000	14.500	2,276,500.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	190,000	15.900	3,021,000.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	83,384	27.050	2,255,537.20	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	84,833	21.850	1,853,601.05	
	SINO LAND CO	248,200	10.240	2,541,568.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	95,500	110.900	10,590,950.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	27,000	66.050	1,783,350.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	116,800	20.900	2,441,120.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	125,000	43.000	5,375,000.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	41,000	42.500	1,742,500.00	
	CLP HOLDINGS LTD	119,600	56.200	6,721,520.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	722,389	7.460	5,389,021.94	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	91,500	42.450	3,884,175.00	
	香港・ドル小計	4,978,654		206,978,967.99 (3,547,619,511)	
シンガポ ール・ド ル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	10,800	28.890	312,012.00	
	KEPPEL CORP LTD	94,400	7.270	686,288.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	108,600	3.630	394,218.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	77,966	5.840	455,321.44	
	GENTING SINGAPORE LTD	327,500	1.020	334,050.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	130,000	3.970	516,100.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	125,800	35.020	4,405,516.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	230,600	13.130	3,027,778.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	75,600	30.980	2,342,088.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	65,200	8.970	584,844.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	176,200	3.870	681,894.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	25,800	7.820	201,756.00	
	UOL GROUP LTD	30,900	6.770	209,193.00	
	VENTURE CORP LTD	21,700	18.490	401,233.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	579,015	2.450	1,418,586.75		
	シンガポール・ドル小計	2,080,081		15,970,878.19 (1,605,871,802)	
ニュー ジー ランド ・ド ル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	78,808	8.620	679,324.96	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,017	26.600	1,037,852.20	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	145,482	5.340	776,873.88	
	MERCURY NZ LTD	38,935	6.475	252,104.12	

	MERIDIAN ENERGY LTD	91,327	5.475	500,015.32	
	ニュージーランド・ドル小計	393,569		3,246,170.48 (271,834,316)	
イギリス・ ポンド	BP PLC	1,281,308	5.599	7,174,043.49	
	SHELL PLC	495,205	25.410	12,583,159.05	
	ANGLO AMERICAN PLC	85,329	32.095	2,738,634.25	
	ANTOFAGASTA PLC	30,983	17.315	536,470.64	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,296	69.940	720,102.24	
	GLENCORE PLC	665,283	5.097	3,390,947.45	
	JOHNSON MATTHEY PLC	10,074	22.200	223,642.80	
	MONDI PLC	33,905	14.945	506,710.22	
	RIO TINTO PLC	76,572	61.030	4,673,189.16	
	ASHTED GROUP PLC	30,439	56.300	1,713,715.70	
	BAE SYSTEMS PLC	209,260	8.938	1,870,365.88	
	BUNZL PLC	22,658	30.660	694,694.28	
	DCC PLC	5,954	46.070	274,300.78	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	305,227	1.436	438,305.97	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	649,146	1.124	729,640.10	
	SMITHS GROUP PLC	24,369	17.750	432,549.75	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	4,459	120.450	537,086.55	
	EXPERIAN PLC	63,031	29.890	1,883,996.59	
	INTERTEK GROUP PLC	11,884	44.900	533,591.60	
	RELX PLC	133,993	24.920	3,339,105.56	
	RENTOKIL INITIAL PLC	156,848	5.114	802,120.67	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,766	4.633	300,060.87	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,637	41.890	278,023.93	
	BURBERRY GROUP PLC	26,233	25.570	670,777.81	
	PERSIMMON PLC	27,665	14.360	397,269.40	
	TAYLOR WIMPEY PLC	225,588	1.202	271,156.77	
	COMPASS GROUP PLC	120,046	19.245	2,310,285.27	
	ENTAIN PLC	42,158	13.975	589,158.05	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	11,820	55.940	661,210.80	
	PEARSON PLC	39,623	9.172	363,422.15	
	WHITBREAD PLC	16,522	31.100	513,834.20	
	JD SPORTS FASHION PLC	144,300	1.808	260,894.40	
KINGFISHER PLC	109,678	2.817	308,962.92		
NEXT PLC	9,030	68.900	622,167.00		
OCADO GROUP PLC	27,379	6.290	172,213.91		
SAINSBURY (J) PLC	113,480	2.644	300,041.12		
TESCO PLC	495,919	2.509	1,244,260.77		
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	24,258	19.325	468,785.85		
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	148,021	31.620	4,680,424.02		
COCA-COLA HBC AG-DI	8,704	21.100	183,654.40		
DIAGEO PLC	157,411	35.605	5,604,618.65		



IMPERIAL BRANDS PLC	59,422	20.370	1,210,426.14		
HALEON PLC	360,325	3.357	1,209,611.02		
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	47,286	57.760	2,731,239.36		
UNILEVER PLC	175,349	42.355	7,426,906.89		
NMC HEALTH PLC	3,940	0.010	39.40		
SMITH & NEPHEW PLC	57,278	11.550	661,560.90		
ASTRAZENECA PLC	105,516	114.860	12,119,567.76		
GSK PLC	280,453	14.842	4,162,483.42		
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	14,590	17.705	258,315.95		
BARCLAYS PLC	1,083,154	1.735	1,879,272.19		
HSBC HOLDINGS PLC	1,365,566	6.211	8,481,530.42		
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,801,858	0.509	2,444,145.72		
NATWEST GROUP PLC	347,420	2.846	988,757.32		
STANDARD CHARTERED PLC	182,397	7.652	1,395,701.84		
3I GROUP PLC	60,807	16.450	1,000,275.15		
ABRDN PLC	138,015	2.160	298,112.40		
HARGREAVES LANSDOWN PLC	31,008	8.536	264,684.28		
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	21,345	76.140	1,625,208.30		
M&G PLC	119,733	2.014	241,142.26		
SCHRODERS PLC	61,711	4.991	307,999.60		
ST JAMES'S PLACE PLC	33,823	12.500	422,787.50		
ADMIRAL GROUP PLC	11,535	22.440	258,845.40		
AVIVA PLC	174,060	4.476	779,092.56		
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	386,391	2.600	1,004,616.60		
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	59,286	6.336	375,636.09		
PRUDENTIAL PLC	193,423	13.065	2,527,071.49		
SAGE GROUP PLC/THE	75,045	7.614	571,392.63		
HALMA PLC	24,375	22.390	545,756.25		
BT GROUP PLC	540,623	1.420	767,684.66		
VODAFONE GROUP PLC	1,775,294	1.023	1,816,125.76		
NATIONAL GRID PLC	245,640	10.700	2,628,348.00		
SEVERN TRENT PLC	20,117	28.070	564,684.19		
SSE PLC	70,532	17.555	1,238,189.26		
UNITED UTILITIES GROUP PLC	42,035	10.505	441,577.67		
AUTO TRADER GROUP PLC	51,319	6.002	308,016.63		
INFORMA PLC	102,755	6.726	691,130.13		
WPP PLC	78,503	10.095	792,487.78		
イギリス・ポンド小計	19,327,390		130,438,017.94 (21,080,088,079)		
イスラエル・シケル	ICL GROUP LTD	41,773	26.360	1,101,136.28	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,389	584.900	812,426.10	
	BANK HAPOLIM BM	84,682	31.170	2,639,537.94	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	115,937	30.110	3,490,863.07	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	85,339	18.310	1,562,557.09	

	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	9,249	116.000	1,072,884.00	
	AZRIELI GROUP LTD	3,527	212.000	747,724.00	
	NICE LTD	3,919	775.000	3,037,225.00	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	7,438	144.600	1,075,534.80	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	179,569	5.420	973,263.98	
	イスラエル・シュケル小計	532,822		16,513,152.26 (626,570,094)	
スイス・フ ラン	CLARIANT AG-REG	10,101	15.870	160,302.87	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	538	715.500	384,939.00	
	GIVAUDAN-REG	605	2,850.000	1,724,250.00	
	HOLCIM LTD	39,459	56.840	2,242,849.56	
	SIG GROUP AG	22,269	22.200	494,371.80	
	SIKA AG-REG	9,946	276.900	2,754,047.40	
	ABB LTD-REG	103,720	31.560	3,273,403.20	
	GEBERIT AG-REG	2,322	517.200	1,200,938.40	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,766	191.400	338,012.40	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,030	199.350	604,030.50	
	VAT GROUP AG	2,164	285.400	617,605.60	
	ADECCO GROUP AG-REG	9,118	34.930	318,491.74	
	SGS SA-REG	458	2,201.000	1,008,058.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	3,570	245.500	876,435.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	36,108	144.000	5,199,552.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,716	330.400	566,966.40	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	5,225	60.750	317,418.75	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	216	1,944.000	419,904.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	72	10,340.000	744,480.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	6	104,200.000	625,200.00	
	NESTLE SA-REG	188,113	109.280	20,556,988.64	
	ALCON INC	32,943	67.660	2,228,923.38	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,269	237.900	777,695.10	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	7,044	129.700	913,606.80	
	BACHEM HOLDING AG	1,756	86.950	152,684.20	
	LONZA GROUP AG-REG	5,251	554.400	2,911,154.40	
	NOVARTIS AG-REG	148,488	80.290	11,922,101.52	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,740	295.600	514,344.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	48,117	279.200	13,434,266.40	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	3,006	83.050	249,648.30	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	241,102	2.730	658,208.46	
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,168	61.460	932,225.28	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,585	920.800	1,459,468.00		
UBS GROUP AG-REG	221,255	20.290	4,489,263.95		
BALOISE HOLDING AG - REG	2,475	152.500	377,437.50		
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,272	554.400	1,259,596.80		
SWISS RE AG	19,228	96.140	1,848,579.92		

	ZURICH INSURANCE GROUP AG	10,454	440.500	4,604,987.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,572	82.250	458,297.00	
	TEMENOS AG - REG	3,743	68.780	257,443.54	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	13,555	53.340	723,023.70	
	SWISSCOM AG-REG	1,709	574.000	980,966.00	
	BKW AG	1,385	134.400	186,144.00	
	スイス・フラン小計	1,231,639		95,768,310.51 (13,909,389,417)	
デンマーク・クローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	7,211	496.000	3,576,656.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	14,003	347.300	4,863,241.90	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	513	1,774.500	910,318.50	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	72,299	205.000	14,821,295.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	206	15,420.000	3,176,520.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	311	15,590.000	4,848,490.00	
	DSV A/S	12,273	1,290.500	15,838,306.50	
	PANDORA A/S	5,888	660.600	3,889,612.80	
	CARLSBERG AS-B	6,611	979.000	6,472,169.00	
	COLOPLAST-B	8,316	813.400	6,764,234.40	
	DEMANT A/S	8,178	217.600	1,779,532.80	
	GENMAB A/S	4,315	2,756.000	11,892,140.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	113,148	986.000	111,563,928.00	
	DANSKE BANK A/S	50,000	152.750	7,637,500.00	
TRYG A/S	24,975	155.800	3,891,105.00		
ORSTED A/S	12,090	630.300	7,620,327.00		
	デンマーク・クローネ小計	340,337		209,545,376.90 (4,040,034,867)	
ノルウェー・クローネ	AKER BP ASA	21,204	277.200	5,877,748.80	
	EQUINOR ASA	66,633	318.050	21,192,625.65	
	NORSK HYDRO ASA	87,753	77.360	6,788,572.08	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,718	464.200	5,903,695.60	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	6,526	430.600	2,810,095.60	
	MOWI ASA	30,723	177.050	5,439,507.15	
	ORKLA ASA	46,955	70.640	3,316,901.20	
	SALMAR ASA	4,188	436.800	1,829,318.40	
	DNB BANK ASA	61,691	197.850	12,205,564.35	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,412	181.700	2,073,560.40	
	TELENOR ASA	48,435	117.200	5,676,582.00	
ADEVINTA ASA	15,540	84.950	1,320,123.00		
	ノルウェー・クローネ小計	413,778		74,434,294.23 (970,623,197)	
スウェーデン・クローナ	BOLIDEN AB	20,658	445.050	9,193,842.90	
	HOLMEN AB-B SHARES	7,024	425.400	2,988,009.60	
	SVENSKA CELLULOZA AB SCA-B	34,370	147.600	5,073,012.00	
	ALFA LAVAL AB	18,697	351.500	6,571,995.50	
	ASSA ABLOY AB-B	72,539	255.700	18,548,222.30	

	ATLAS COPCO AB-A SHS	185,739	125.280	23,269,381.92	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	107,424	110.420	11,861,758.08	
	EPIROC AB-A	44,746	203.500	9,105,811.00	
	EPIROC AB-B	19,836	174.900	3,469,316.40	
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	92.000	1,710,556.00	
	INDUTRADE AB	17,913	233.000	4,173,729.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,223	230.200	1,892,934.60	
	LIFCO AB-B SHS	15,149	214.300	3,246,430.70	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	109,274	122.750	13,413,383.50	
	SANDVIK AB	70,108	218.400	15,311,587.20	
	SKANSKA AB-B SHS	26,915	194.950	5,247,079.25	
	SKF AB-B SHARES	31,715	200.000	6,343,000.00	
	VOLVO AB-A SHS	13,283	218.600	2,903,663.80	
	VOLVO AB-B SHS	101,613	209.350	21,272,681.55	
	SECURITAS AB-B SHS	41,010	92.520	3,794,245.20	
	VOLVO CAR AB-B	38,628	50.830	1,963,461.24	
	ELECTROLUX AB-B	11,555	127.680	1,475,342.40	
	EVOLUTION AB	13,101	1,317.000	17,254,017.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	52,210	130.500	6,813,405.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	45,427	280.000	12,719,560.00	
	GETINGE AB-B SHS	13,151	234.100	3,078,649.10	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	13,513	236.900	3,201,229.70	
	NORDEA BANK ABP	229,567	128.260	29,444,263.42	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	108,374	127.900	13,861,034.60	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	97,603	107.850	10,526,483.55	
	SWEDBANK AB - A SHARES	57,603	208.600	12,015,985.80	
	EQT AB	23,194	248.000	5,752,112.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	7,211	288.000	2,076,768.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,642	287.300	3,057,446.60	
	INVESTOR AB-A SHS	37,586	208.100	7,821,646.60	
	INVESTOR AB-B SHS	120,729	203.700	24,592,497.30	
	KINNEVIK AB - B	12,465	160.750	2,003,748.75	
	LUNDBERGS AB-B SHS	6,081	493.300	2,999,757.30	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	31,938	53.330	1,703,253.54	
	SAGAX AB-B	14,721	258.400	3,803,906.40	
	ERICSSON LM-B SHS	183,318	60.310	11,055,908.58	
	HEXAGON AB-B SHS	135,861	119.100	16,181,045.10	
	TELE2 AB-B SHS	38,424	93.640	3,598,023.36	
	TELIA CO AB	187,675	26.720	5,014,676.00	
	EMBRACER GROUP AB	30,012	55.180	1,656,062.16	
	スウェーデン・クローナ小計	2,485,418		373,060,924.00 (4,790,102,264)	
ユーロ	ENI SPA	175,361	14.300	2,507,662.30	
	GALP ENERGIA SGPS SA	32,353	11.655	377,074.21	

NESTE OYJ	26,563	45.010	1,195,600.63
OMV AG	10,043	45.710	459,065.53
REPSOL SA	96,457	15.015	1,448,301.85
TENARIS SA	31,142	16.515	514,310.13
TOTALENERGIES SE	169,438	58.660	9,939,233.08
AIR LIQUIDE SA	35,636	149.420	5,324,731.12
AKZO NOBEL N.V.	12,475	69.860	871,503.50
ARCELORMITTAL	37,054	28.260	1,047,146.04
ARKEMA	3,250	93.840	304,980.00
BASF SE	64,323	52.240	3,360,233.52
COVESTRO AG	11,797	42.040	495,945.88
CRH PLC	49,499	43.860	2,171,026.14
EVONIK INDUSTRIES AG	17,669	20.010	353,556.69
HEIDELBERGCEMENT AG	8,677	64.420	558,972.34
KONINKLIJKE DSM NV	12,174	123.400	1,502,271.60
OCI NV	6,000	30.140	180,840.00
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	17,189	36.290	623,788.81
SOLVAY SA	4,802	109.400	525,338.80
STORA ENSO OYJ-R SHS	39,228	13.450	527,616.60
SYMRISE AG	8,404	96.060	807,288.24
UMICORE	13,160	32.400	426,384.00
UPM-KYMMENE OYJ	38,447	34.060	1,309,504.82
VOESTALPINE AG	9,836	34.320	337,571.52
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	13,416	27.480	368,671.68
AIRBUS SE	40,988	125.660	5,150,552.08
ALSTOM	17,665	27.320	482,607.80
BOUYGUES SA	17,123	31.770	543,997.71
BRENTAG SE	9,920	72.920	723,366.40
CNH INDUSTRIAL NV	68,766	15.565	1,070,342.79
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	34,454	54.520	1,878,432.08
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	29,358	31.425	922,575.15
DASSAULT AVIATION SA	1,720	164.000	282,080.00
EIFFAGE	4,989	103.250	515,114.25
FERROVIAL SA	32,177	26.490	852,368.73
GEA GROUP AG	8,178	41.090	336,034.02
IMCD NV	3,214	151.650	487,403.10
KINGSPAN GROUP PLC	11,262	63.420	714,236.04
KNORR-BREMSE AG	3,881	63.600	246,831.60
KONE OYJ-B	24,225	48.490	1,174,670.25
LEGRAND SA	16,852	89.520	1,508,591.04
MTU AERO ENGINES AG	3,854	234.000	901,836.00
PRYSMIAN SPA	17,186	37.700	647,912.20
RATIONAL AG	350	618.000	216,300.00
RHEINMETALL AG	2,899	249.600	723,590.40

SAFRAN SA	23,990	136.860	3,283,271.40
SCHNEIDER ELECTRIC SE	37,574	156.260	5,871,313.24
SIEMENS AG-REG	52,620	145.440	7,653,052.80
SIEMENS ENERGY AG	31,878	19.200	612,057.60
THALES SA	7,074	129.700	917,497.80
VINCI SA	36,202	109.540	3,965,567.08
WARTSILA OYJ ABP	26,753	9.312	249,123.93
BUREAU VERITAS SA	17,817	26.260	467,874.42
RANDSTAD NV	8,946	59.240	529,961.04
TELEPERFORMANCE	4,299	255.500	1,098,394.50
WOLTERS KLUWER	18,802	103.500	1,946,007.00
ADP	1,346	135.400	182,248.40
AENA SME SA	5,640	140.400	791,856.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	33,148	9.730	322,530.04
DEUTSCHE POST AG-REG	69,811	40.600	2,834,326.60
GETLINK SE	30,428	16.455	500,692.74
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	22,804	99.750	2,274,699.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	3,679	91.650	337,180.35
CONTINENTAL AG	8,078	69.620	562,390.36
DR ING HC F PORSCHE AG	7,000	114.100	798,700.00
FERRARI NV	8,992	249.000	2,239,008.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	55,881	74.640	4,170,957.84
MICHELIN (CGDE)	45,659	30.335	1,385,065.76
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	10,089	55.600	560,948.40
RENAULT SA	14,764	42.210	623,188.44
STELLANTIS NV	149,423	15.950	2,383,296.85
VALEO	14,444	21.080	304,479.52
VOLKSWAGEN AG	1,960	166.800	326,928.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	11,844	131.220	1,554,169.68
ADIDAS AG	12,090	143.520	1,735,156.80
HERMES INTERNATIONAL	2,137	1,747.000	3,733,339.00
KERING	5,266	590.000	3,106,940.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	18,967	818.400	15,522,592.80
MONCLER SPA	12,209	57.660	703,970.94
PUMA SE	6,459	61.320	396,065.88
SEB SA	1,127	99.800	112,474.60
ACCOR SA	10,451	30.050	314,052.55
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	12,030	154.550	1,859,236.50
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,785	37.550	217,226.75
SODEXO SA	4,760	86.680	412,596.80
DELIVERY HERO SE	13,293	40.380	536,771.34
D'IETTEREN GROUP	1,858	187.800	348,932.40
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	71,341	28.800	2,054,620.80
JUST EAT TAKEAWAY	12,903	21.530	277,801.59

PROSUS NV	55,136	73.000	4,024,928.00
ZALANDO SE	17,418	39.780	692,888.04
CARREFOUR SA	35,990	18.150	653,218.50
HELLOFRESH SE	9,790	21.870	214,107.30
JERONIMO MARTINS	21,241	20.300	431,192.30
KESKO OYJ-B SHS	20,250	20.310	411,277.50
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	71,069	29.735	2,113,236.71
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	60,855	55.010	3,347,633.55
DANONE	45,570	52.090	2,373,741.30
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	35,407	10.490	371,419.43
HEINEKEN HOLDING NV	6,168	78.300	482,954.40
HEINEKEN NV	18,666	95.660	1,785,589.56
JDE PEET'S NV	6,660	27.700	184,482.00
KERRY GROUP PLC-A	9,894	93.040	920,537.76
PERNOD RICARD SA	13,733	194.950	2,677,248.35
REMY COINTREAU	1,273	167.700	213,482.10
BEIERSDORF AG	6,813	113.200	771,231.60
HENKEL AG & CO KGAA	5,974	64.100	382,933.40
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	13,009	67.240	874,725.16
L'OREAL	16,700	384.600	6,422,820.00
AMPLIFON SPA	7,567	27.400	207,335.80
BIOMERIEUX	2,791	95.780	267,321.98
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,161	133.500	288,493.50
DIASORIN SPA	1,313	116.300	152,701.90
ESSILORLUXOTTICA	19,585	174.600	3,419,541.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	13,613	37.470	510,079.11
FRESENIUS SE & CO KGAA	31,227	28.990	905,270.73
KONINKLIJKE PHILIPS NV	61,140	15.846	968,824.44
SIEMENS HEALTHINEERS AG	19,203	50.320	966,294.96
ARGENX SE	3,754	345.800	1,298,133.20
BAYER AG-REG	68,041	59.120	4,022,583.92
EUROFINS SCIENTIFIC	9,270	67.920	629,618.40
GRIFOLS SA	15,169	14.280	216,613.32
IPSEN	3,380	107.700	364,026.00
MERCK KGAA	8,996	183.450	1,650,316.20
ORION OYJ-CLASS B	6,261	45.350	283,936.35
QIAGEN N.V.	15,665	44.730	700,695.45
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	8,068	41.100	331,594.80
SANOFI	78,739	89.100	7,015,644.90
SARTORIUS AG-VORZUG	1,682	427.100	718,382.20
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,555	330.600	514,083.00
UCB SA	7,782	77.900	606,217.80
ABN AMRO BANK NV-CVA	28,787	16.535	475,993.04
AIB GROUP PLC	70,110	3.930	275,532.30

BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	420,232	6.976	2,931,538.43
BANCO SANTANDER SA	1,160,000	3.524	4,087,840.00
BANK OF IRELAND GROUP PLC	75,242	9.776	735,565.79
BNP PARIBAS	77,135	65.430	5,046,943.05
CAIXABANK SA	290,777	4.111	1,195,384.24
COMMERZBANK AG	60,640	11.380	690,083.20
CREDIT AGRICOLE SA	90,899	11.750	1,068,063.25
ERSTE GROUP BANK AG	24,737	36.370	899,684.69
FINECOBANK SPA	43,093	16.720	720,514.96
ING GROEP NV	254,105	13.212	3,357,235.26
INTESA SANPAOLO	1,163,000	2.564	2,981,932.00
KBC GROUP NV	17,643	71.820	1,267,120.26
MEDIOBANCA SPA	47,708	10.255	489,245.54
SOCIETE GENERALE SA	55,196	27.860	1,537,760.56
UNICREDIT SPA	127,961	19.558	2,502,661.23
AMUNDI SA	3,955	62.950	248,967.25
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	146,020	11.880	1,734,717.60
DEUTSCHE BOERSE AG	12,983	171.450	2,225,935.35
EURAZEO SE	1,792	64.900	116,300.80
EURONEXT NV	5,502	77.160	424,534.32
EXOR NV	8,669	76.180	660,404.42
GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	5,914	79.700	471,345.80
SOFINA	804	234.400	188,457.60
WENDEL	1,082	101.200	109,498.40
AEGON NV	127,748	5.170	660,457.16
AGEAS	11,247	43.540	489,694.38
ALLIANZ SE-REG	28,239	216.950	6,126,451.05
ASSICURAZIONI GENERALI	72,382	18.320	1,326,038.24
AXA SA	125,908	28.325	3,566,344.10
HANNOVER RUECK SE	3,598	181.950	654,656.10
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	9,828	329.900	3,242,257.20
NN GROUP NV	16,917	40.610	686,999.37
POSTE ITALIANE SPA	34,720	10.225	355,012.00
SAMPO OYJ-A SHS	33,064	45.450	1,502,758.80
AROUNDTOWN SA	73,508	2.514	184,799.11
LEG IMMOBILIEN SE	4,538	70.540	320,110.52
VONOVIA SE	46,339	25.460	1,179,790.94
ADYEN NV	1,394	1,466.800	2,044,719.20
AMADEUS IT GROUP SA	29,928	57.020	1,706,494.56
BECHTLE AG	4,305	40.480	174,266.40
CAPGEMINI SE	11,555	186.000	2,149,230.00
DASSAULT SYSTEMES SE	46,266	37.445	1,732,430.37
EDENRED	14,650	52.040	762,386.00
NEMETSCHKE SE	3,011	50.660	152,537.26



NEXI SPA	30,853	7.850	242,196.05	
SAP SE	71,964	109.480	7,878,618.72	
WORLDLINE SA	16,677	41.110	685,591.47	
NOKIA OYJ	379,853	4.457	1,693,004.82	
ASM INTERNATIONAL NV	3,170	323.050	1,024,068.50	
ASML HOLDING NV	27,834	610.300	16,987,090.20	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	88,617	35.235	3,122,419.99	
STMICROELECTRONICS NV	48,663	45.905	2,233,875.01	
CELLNEX TELECOM SA	35,630	37.980	1,353,227.40	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	225,304	20.760	4,677,311.04	
ELISA OYJ	10,160	53.100	539,496.00	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,804	10.475	165,546.90	
KONINKLIJKE KPN NV	222,179	3.250	722,081.75	
ORANGE	127,798	10.714	1,369,227.77	
TELECOM ITALIA SPA	696,355	0.313	217,959.11	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	79,654	2.831	225,500.47	
TELEFONICA SA	357,425	3.816	1,363,933.80	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,269	20.800	109,595.20	
ACCIONA SA	1,810	186.800	338,108.00	
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	4,317	38.000	164,046.00	
E.ON SE	147,318	10.165	1,497,487.47	
EDP RENOVAVEIS SA	17,764	19.890	353,325.96	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	195,232	4.705	918,566.56	
ELIA GROUP SA/NV	2,111	129.500	273,374.50	
ENAGAS SA	14,471	16.855	243,908.70	
ENDESA SA	25,535	19.045	486,314.07	
ENEL SPA	566,643	5.353	3,033,239.97	
ENGIE	117,899	13.500	1,591,636.50	
FORTUM OYJ	24,312	14.430	350,822.16	
IBERDROLA SA	427,172	10.900	4,656,174.80	
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,603	26.760	283,736.28	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	23,632	16.315	385,556.08	
RWE AG	44,264	39.520	1,749,313.28	
SNAM SPA	133,867	4.772	638,813.32	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA	101,686	7.392	751,662.91	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	48,732	28.450	1,386,425.40	
VERBUND AG	4,503	80.850	364,067.55	
BOLLORE SE	69,288	5.170	358,218.96	
PUBLICIS GROUPE	15,558	75.580	1,175,873.64	
SCOUT24 SE	4,671	51.860	242,238.06	
UBISOFT ENTERTAINMENT	4,745	20.430	96,940.35	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	49,395	22.520	1,112,375.40	
VIVENDI SE	57,161	9.880	564,750.68	
グーロ小計	12,552,682		325,471,795.03	

			(46,714,966,741)	
合計	74,656,934		447,345,580,983 (447,345,580,983)	

(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	601銘柄	68.9%	72.2%
カナダ・ドル	株式	87銘柄	3.6%	3.7%
オーストラリア・ドル	株式	49銘柄	2.1%	2.2%
香港・ドル	株式	27銘柄	0.8%	0.8%
シンガポール・ドル	株式	15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	78銘柄	4.5%	4.7%
イスラエル・シケル	株式	10銘柄	0.1%	0.1%
スイス・フラン	株式	43銘柄	3.0%	3.1%
デンマーク・クローネ	株式	16銘柄	0.9%	0.9%
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	45銘柄	1.0%	1.1%
ユーロ	株式	221銘柄	10.0%	10.4%

#### (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	11,189.00	1,807,918.62	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	20,093.00	668,092.25	
		AMERICAN TOWER CORP	32,161.00	6,762,171.86	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	35,166.00	759,233.94	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	9,096.00	1,630,639.92	
		BOSTON PROPERTIES INC	9,604.00	676,505.76	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,009.00	721,380.45	
		CROWN CASTLE INC	29,077.00	4,090,552.36	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	20,462.00	2,266,371.12	
		EQUINIX INC	6,342.00	4,545,691.92	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	11,186.00	804,049.68	
		EQUITY RESIDENTIAL	22,609.00	1,489,480.92	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,379.00	1,037,078.57	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	8,530.00	1,356,184.70	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	17,613.00	927,852.84	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	22,843.00	478,789.28	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	36,377.00	950,531.01	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	46,189.00	782,441.66	
		INVITATION HOMES INC	44,730.00	1,459,539.90	
		IRON MOUNTAIN INC	19,659.00	1,034,063.40	
KIMCO REALTY CORP	44,824.00	948,027.60			
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	48,792.00	632,344.32			

	MID-AMERICA APARTMENT COMM	7,866.00	1,324,162.44	
	PROLOGIS INC	63,644.00	7,975,866.08	
	PUBLIC STORAGE	11,097.00	3,318,113.97	
	REALTY INCOME CORP	42,018.00	2,778,230.16	
	REGENCY CENTERS CORP	9,608.00	618,082.64	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	7,141.00	2,008,334.84	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	22,292.00	2,756,628.72	
	SUN COMMUNITIES INC	8,247.00	1,303,438.35	
	UDR INC	20,610.00	922,297.50	
	VENTAS INC	28,342.00	1,430,137.32	
	VICI PROPERTIES INC	68,586.00	2,324,379.54	
	WELLTOWER INC	31,795.00	2,460,933.00	
	WEYERHAEUSER CO	47,220.00	1,520,484.00	
	WP CAREY INC	13,861.00	1,163,353.73	
	アメリカ・ドル小計	889,257.00	67,733,384.37 (9,106,753,530)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,170.00	408,500.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,441.00	166,008.71	
	カナダ・ドル小計	15,611.00	574,508.71 (57,249,793)	
オーストラリア・ドル	APA GROUP	75,718.00	822,297.48	
	DEXUS/AU	79,604.00	690,962.72	
	GOODMAN GROUP	119,422.00	2,374,109.36	
	GPT GROUP	121,221.00	563,677.65	
	LENLEASE GROUP	36,263.00	281,400.88	
	MIRVAC GROUP	251,619.00	561,110.37	
	SCENTRE GROUP	350,311.00	1,029,914.34	
	STOCKLAND	193,824.00	752,037.12	
	TRANSURBAN GROUP	210,600.00	2,963,142.00	
	VICINITY CENTRES	241,241.00	504,193.69	
	オーストラリア・ドル小計	1,679,823.00	10,542,845.61 (973,420,935)	
香港・ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	193,500.00	996,525.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	276,000.00	2,870,400.00	
	LINK REIT	136,600.00	7,246,630.00	
	香港・ドル小計	606,100.00	11,113,555.00 (190,486,333)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	219,000.00	608,820.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	408,716.00	792,909.04	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	208,100.00	347,527.00	
	MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	112,400.00	193,328.00	
	シンガポール・ドル小計	948,216.00	1,942,584.04 (195,326,825)	
	BRITISH LAND CO PLC	49,008.00	219,408.81	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	59,857.00	419,956.71	

イギリス・ポンド	SEGRO PLC	78,831.00	682,834.12	
イギリス・ポンド小計		187,696.00	1,322,199.64 (213,680,684)	
ユーロ	COVIVIO	2,388.00	149,847.00	
	GECINA SA	3,082.00	339,328.20	
	KLEPIERRE	13,600.00	324,632.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	8,942.00	541,438.10	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	14,062.00	420,735.04	
ユーロ小計		42,074.00	1,775,980.34 (254,906,458)	
投資証券合計			10,991,824,558 (10,991,824,558)	
合 計			10,991,824,558 (10,991,824,558)	

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

通貨	銘柄数		組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券	36銘柄	1.9%	82.9%
カナダ・ドル	投資証券	2銘柄	0.0%	0.5%
オーストラリア・ドル	投資証券	10銘柄	0.2%	8.9%
香港・ドル	投資証券	3銘柄	0.0%	1.7%
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%	1.9%
ユーロ	投資証券	5銘柄	0.1%	2.3%

#### 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)

	(2022年2月18日現在)	(2023年2月20日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	295,192,543	420,137,655
金銭信託	17,377,478	27,452,528
コール・ローン	576,289,998	542,885,324
国債証券	157,287,798,602	149,970,158,950
未収利息	879,152,772	936,129,638
前払費用	40,297,673	76,300,180
流動資産合計	159,096,109,066	151,973,064,275
資産合計	159,096,109,066	151,973,064,275
負債の部		

流動負債		
未払金	-	38,956,261
未払解約金	75,631,864	360,727,345
その他未払費用	1,657	2,185
流動負債合計	75,633,521	399,685,791
負債合計	75,633,521	399,685,791
純資産の部		
元本等		
元本	82,333,458,509	78,149,894,072
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	76,687,017,036	73,423,484,412
元本等合計	159,020,475,545	151,573,378,484
純資産合計	159,020,475,545	151,573,378,484
負債純資産合計	159,096,109,066	151,973,064,275

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2022年2月19日 至 2023年2月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## ( 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	( 2022年2月18日現在 )	( 2023年2月20日現在 )
-----	------------------	------------------

1. 当計算期間の末日における 受益権の総数	82,333,458,509口	78,149,894,072口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.9314円 (1万口当たりの純資産額19,314円)	1口当たり純資産額 1.9395円 (1万口当たりの純資産額19,395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 2022年2月19日 至 2023年2月20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	(2023年2月20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 2022年2月19日

至 2023年2月20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)

(2022年2月18日現在)

## 開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	85,310,011,496円
同期中における追加設定元本額	11,473,990,193円
同期中における一部解約元本額	14,450,543,180円
2022年2月18日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	24,403,685,095円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	783,841,444円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,118,559,104円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,127,638,898円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	155,967,328円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	6,821,569円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	30,321,807円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	101,022,148円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	220,516,443円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	150,076,179円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	254,838,761円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	25,046,133円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	130,124,805円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	160,182,252円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	103,340,335円
イオン・バランス戦略ファンド	374,224,537円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	17,284,763円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	70,404,701円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	51,857,305円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	129,364,807円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	36,477,847円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	18,531,301円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	127,198,869円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	255,450,964円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	12,560,303円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	37,237,962円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	24,650,918円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,273,756円
日興F W S・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	209,568,844円
三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド	9,114,932円
S M A M・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	3,822,965,793円
S M A M・バランスファンドV A安定成長型<適格機関投資家限定>	43,079,590円
S M A M・バランスファンドV A 2 5<適格機関投資家専用>	7,067,972,003円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用>	4,468,947,996円
S M A M・バランスファンドV A 5 0<適格機関投資家専用>	10,380,262,333円
S M A M・バランスファンドV L 3 0<適格機関投資家限定>	34,879,317円
S M A M・バランスファンドV L 5 0<適格機関投資家限定>	91,028,746円



SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	687,505,196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>	116,879,699円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,043,370,554円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,438,731,860円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,535,320,106円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	4,784,606,906円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	627,347円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	8,084,567,238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）	325,350,941円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	143,270,463円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	81,175,759円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	33,971,193円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,926,289円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	96,352,849円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	419,212,344円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	103,325,580円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	40,181,590円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,252,180円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,025,821,385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>	629,786,209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>	937,884,754円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	913,843,267円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	381,703,472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>	208,293,939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>	179,506,411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>	229,045,007円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド <適格機関投資家限定>	1,818,626,083円
合計	82,333,458,509円

(2023年2月20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	82,333,458,509円
同期中における追加設定元本額	11,125,531,084円
同期中における一部解約元本額	15,309,095,521円

## 2023年2月20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	26,114,593,808円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	897,622,791円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	2,277,304,683円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	1,269,134,694円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	163,762,412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）	6,297,588円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	29,502,621円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）	102,718,935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）	268,930,247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）	195,766,919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）	310,561,552円

三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	24,106,305円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	116,200,545円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	152,961,156円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	97,271,094円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	29,148,525円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	87,757,719円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	65,514,212円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	177,153,519円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	52,809,123円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	26,615,507円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	186,388,452円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	740,469,062円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	36,230,420円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	110,716,800円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	75,508,558円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	3,803,824円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	890,014,503円
三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド	90,944,838円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	27,622円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	32,834円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	40,651円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	47,947円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	47,947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>	4,127,762,178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>	5,611,457,006円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	3,950,525,621円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	9,244,600,710円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	29,825,111円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	74,453,005円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	637,751,835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>	108,360,283円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	942,176,072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>	1,323,429,747円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	4,101,843,816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>	7,085,943,621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)	347,826,035円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	118,096,909円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	67,375,516円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	30,968,221円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,644,067円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	79,129,938円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	363,615,745円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	87,782,097円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	37,478,954円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,563,850円

SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	894,241,280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>	536,701,272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>	733,398,496円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	403,957,887円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	271,348,478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>	80,252,402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>	51,570,634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>	66,141,197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>	824,985,964円
合計	78,149,894,072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	7,339,101.00	
		T 0.25 05/31/25	4,400,000.00	4,000,216.00	
		T 0.25 06/30/25	2,900,000.00	2,631,837.00	
		T 0.25 07/31/25	300,000.00	271,380.00	
		T 0.25 09/30/25	2,000,000.00	1,800,780.00	
		T 0.25 10/31/25	1,000,000.00	896,830.00	
		T 0.375 04/30/25	3,000,000.00	2,743,590.00	
		T 0.375 07/31/27	2,500,000.00	2,126,650.00	
		T 0.375 09/15/24	3,000,000.00	2,800,890.00	
		T 0.375 09/30/27	4,800,000.00	4,063,680.00	
		T 0.375 11/30/25	2,000,000.00	1,794,760.00	
		T 0.375 12/31/25	3,000,000.00	2,688,840.00	
		T 0.5 03/31/25	1,600,000.00	1,471,488.00	
		T 0.5 04/30/27	1,200,000.00	1,034,712.00	
		T 0.5 05/31/27	2,500,000.00	2,149,100.00	
		T 0.5 06/30/27	4,000,000.00	3,430,920.00	
		T 0.5 10/31/27	1,000,000.00	849,330.00	
		T 0.625 03/31/27	2,400,000.00	2,086,296.00	
		T 0.625 05/15/30	7,500,000.00	5,981,250.00	
		T 0.625 07/31/26	3,600,000.00	3,187,404.00	
		T 0.625 08/15/30	7,000,000.00	5,551,280.00	
		T 0.625 10/15/24	4,400,000.00	4,113,648.00	
		T 0.625 11/30/27	3,400,000.00	2,899,146.00	
		T 0.625 12/31/27	7,200,000.00	6,123,888.00	
T 0.75 01/31/28	5,900,000.00	5,038,718.00			
T 0.75 11/15/24	5,200,000.00	4,857,008.00			

T 0.875 01/31/24	2,000,000.00	1,923,200.00	
T 0.875 11/15/30	7,000,000.00	5,639,620.00	
T 1 07/31/28	5,900,000.00	5,038,246.00	
T 1 12/15/24	4,500,000.00	4,211,595.00	
T 1.125 01/15/25	2,000,000.00	1,873,040.00	
T 1.125 02/15/31	8,500,000.00	6,970,935.00	
T 1.125 02/28/25	1,500,000.00	1,400,565.00	
T 1.125 02/28/27	2,000,000.00	1,780,460.00	
T 1.125 05/15/40	2,000,000.00	1,284,520.00	
T 1.125 08/15/40	3,100,000.00	1,978,668.00	
T 1.125 08/31/28	3,500,000.00	3,004,505.00	
T 1.25 05/15/50	5,100,000.00	2,847,891.00	
T 1.25 06/30/28	3,000,000.00	2,603,670.00	
T 1.25 08/15/31	5,200,000.00	4,248,556.00	
T 1.25 09/30/28	4,500,000.00	3,882,285.00	
T 1.25 11/30/26	4,200,000.00	3,771,936.00	
T 1.25 12/31/26	2,300,000.00	2,062,525.00	
T 1.375 01/31/25	1,900,000.00	1,786,361.00	
T 1.375 08/15/50	4,500,000.00	2,596,005.00	
T 1.375 08/31/26	7,100,000.00	6,446,232.00	
T 1.375 10/31/28	6,000,000.00	5,203,800.00	
T 1.375 11/15/31	4,900,000.00	4,019,323.00	
T 1.375 11/15/40	3,500,000.00	2,329,950.00	
T 1.375 12/31/28	2,500,000.00	2,162,975.00	
T 1.5 01/31/27	4,400,000.00	3,976,720.00	
T 1.5 02/15/25	3,000,000.00	2,823,780.00	
T 1.5 02/15/30	2,100,000.00	1,799,007.00	
T 1.5 09/30/24	3,000,000.00	2,848,470.00	
T 1.5 10/31/24	5,500,000.00	5,210,810.00	
T 1.5 11/30/24	800,000.00	756,664.00	
T 1.5 11/30/28	2,300,000.00	2,006,198.00	
T 1.625 02/15/26	2,900,000.00	2,683,718.00	
T 1.625 05/15/26	12,450,000.00	11,465,080.50	
T 1.625 05/15/31	5,500,000.00	4,659,490.00	
T 1.625 08/15/29	4,950,000.00	4,313,034.00	
T 1.625 09/30/26	3,900,000.00	3,567,720.00	
T 1.625 11/15/50	3,200,000.00	1,973,120.00	
T 1.625 11/30/26	200,000.00	182,452.00	
T 1.75 01/31/29	4,300,000.00	3,794,062.00	
T 1.75 03/15/25	1,500,000.00	1,416,795.00	
T 1.75 06/30/24	6,200,000.00	5,942,638.00	
T 1.75 07/31/24	850,000.00	812,974.00	
T 1.75 08/15/41	4,400,000.00	3,085,412.00	
T 1.75 11/15/29	1,300,000.00	1,140,386.00	

T 1.75 12/31/24	4,000,000.00	3,793,400.00	
T 1.75 12/31/26	3,500,000.00	3,203,970.00	
T 1.875 02/15/32	5,300,000.00	4,523,179.00	
T 1.875 02/15/41	3,300,000.00	2,389,662.00	
T 1.875 02/15/51	5,800,000.00	3,809,846.00	
T 1.875 02/28/27	3,400,000.00	3,114,502.00	
T 1.875 02/28/29	2,800,000.00	2,488,052.00	
T 1.875 08/31/24	3,800,000.00	3,633,446.00	
T 1.875 11/15/51	3,300,000.00	2,157,177.00	
T 2 02/15/25	3,500,000.00	3,328,535.00	
T 2 02/15/50	2,800,000.00	1,908,788.00	
T 2 04/30/24	2,000,000.00	1,931,200.00	
T 2 05/31/24	3,300,000.00	3,179,583.00	
T 2 06/30/24	4,100,000.00	3,941,576.00	
T 2 08/15/25	3,300,000.00	3,113,451.00	
T 2 08/15/51	2,900,000.00	1,958,834.00	
T 2 11/15/26	5,000,000.00	4,623,200.00	
T 2 11/15/41	3,800,000.00	2,778,142.00	
T 2.125 02/29/24	2,000,000.00	1,942,040.00	
T 2.125 03/31/24	6,500,000.00	6,299,735.00	
T 2.125 05/15/25	600,000.00	569,760.00	
T 2.125 07/31/24	3,500,000.00	3,365,985.00	
T 2.125 09/30/24	4,000,000.00	3,836,320.00	
T 2.125 11/30/24	2,600,000.00	2,486,198.00	
T 2.25 01/31/24	2,200,000.00	2,143,548.00	
T 2.25 02/15/27	4,400,000.00	4,096,268.00	
T 2.25 02/15/52	1,700,000.00	1,218,679.00	
T 2.25 03/31/26	11,200,000.00	10,549,840.00	
T 2.25 04/30/24	3,800,000.00	3,679,958.00	
T 2.25 05/15/41	3,000,000.00	2,307,480.00	
T 2.25 08/15/27	4,200,000.00	3,886,302.00	
T 2.25 08/15/46	2,450,000.00	1,787,250.50	
T 2.25 08/15/49	3,500,000.00	2,532,285.00	
T 2.25 10/31/24	800,000.00	767,336.00	
T 2.25 11/15/24	5,100,000.00	4,891,716.00	
T 2.25 11/15/25	4,000,000.00	3,783,400.00	
T 2.25 11/15/27	4,400,000.00	4,059,000.00	
T 2.25 12/31/24	3,900,000.00	3,732,573.00	
T 2.375 02/15/42	2,800,000.00	2,180,500.00	
T 2.375 02/29/24	3,700,000.00	3,602,172.00	
T 2.375 03/31/29	5,000,000.00	4,564,050.00	
T 2.375 05/15/27	3,000,000.00	2,796,780.00	
T 2.375 05/15/29	2,400,000.00	2,188,200.00	
T 2.375 05/15/51	3,900,000.00	2,880,657.00	

T 2.375 08/15/24	5,600,000.00	5,399,576.00	
T 2.375 11/15/49	1,900,000.00	1,412,156.00	
T 2.5 01/31/25	3,400,000.00	3,267,026.00	
T 2.5 02/15/45	1,400,000.00	1,082,256.00	
T 2.5 02/15/46	1,000,000.00	768,710.00	
T 2.5 02/28/26	2,100,000.00	1,993,803.00	
T 2.5 03/31/27	3,000,000.00	2,814,900.00	
T 2.5 05/15/24	2,200,000.00	2,135,100.00	
T 2.5 05/15/46	1,600,000.00	1,229,056.00	
T 2.625 01/31/26	2,200,000.00	2,099,438.00	
T 2.625 02/15/29	1,800,000.00	1,669,212.00	
T 2.625 03/31/25	1,000,000.00	961,560.00	
T 2.625 04/15/25	4,500,000.00	4,323,825.00	
T 2.625 05/31/27	4,800,000.00	4,519,680.00	
T 2.625 07/31/29	1,100,000.00	1,016,422.00	
T 2.625 12/31/25	1,400,000.00	1,337,644.00	
T 2.75 02/15/24	5,100,000.00	4,987,035.00	
T 2.75 02/15/28	4,800,000.00	4,523,040.00	
T 2.75 02/28/25	2,000,000.00	1,929,600.00	
T 2.75 04/30/27	2,700,000.00	2,556,873.00	
T 2.75 05/15/25	3,000,000.00	2,887,500.00	
T 2.75 05/31/29	1,400,000.00	1,304,450.00	
T 2.75 06/30/25	900,000.00	865,575.00	
T 2.75 08/15/32	4,200,000.00	3,844,302.00	
T 2.75 08/15/42	2,000,000.00	1,649,280.00	
T 2.75 08/15/47	1,800,000.00	1,444,554.00	
T 2.75 08/31/25	3,400,000.00	3,264,918.00	
T 2.75 11/15/42	300,000.00	246,759.00	
T 2.75 11/15/47	1,500,000.00	1,204,095.00	
T 2.875 04/30/25	400,000.00	386,216.00	
T 2.875 04/30/29	3,500,000.00	3,286,710.00	
T 2.875 05/15/28	8,200,000.00	7,754,248.00	
T 2.875 05/15/32	5,700,000.00	5,280,024.00	
T 2.875 05/15/43	1,200,000.00	1,004,808.00	
T 2.875 05/15/49	1,400,000.00	1,155,322.00	
T 2.875 05/15/52	3,200,000.00	2,635,616.00	
T 2.875 05/31/25	3,100,000.00	2,991,376.00	
T 2.875 06/15/25	2,000,000.00	1,930,220.00	
T 2.875 08/15/28	4,500,000.00	4,247,370.00	
T 2.875 08/15/45	800,000.00	660,336.00	
T 2.875 11/15/46	900,000.00	741,015.00	
T 2.875 11/30/25	2,500,000.00	2,404,875.00	
T 3 02/15/47	2,500,000.00	2,103,300.00	
T 3 02/15/48	2,400,000.00	2,019,168.00	

T 3 02/15/49	3,300,000.00	2,788,368.00	
T 3 05/15/42	800,000.00	689,056.00	
T 3 05/15/45	900,000.00	760,140.00	
T 3 05/15/47	1,800,000.00	1,513,962.00	
T 3 07/15/25	2,000,000.00	1,934,140.00	
T 3 08/15/48	900,000.00	757,926.00	
T 3 08/15/52	3,000,000.00	2,536,380.00	
T 3 09/30/25	1,000,000.00	965,190.00	
T 3 10/31/25	2,600,000.00	2,509,026.00	
T 3 11/15/44	1,000,000.00	846,640.00	
T 3 11/15/45	800,000.00	674,936.00	
T 3.125 02/15/42	1,000,000.00	880,890.00	
T 3.125 02/15/43	2,300,000.00	2,007,808.00	
T 3.125 05/15/48	2,400,000.00	2,067,360.00	
T 3.125 08/15/25	3,000,000.00	2,908,920.00	
T 3.125 08/15/44	2,300,000.00	1,990,397.00	
T 3.125 11/15/28	2,900,000.00	2,768,804.00	
T 3.125 11/15/41	1,000,000.00	883,940.00	
T 3.25 05/15/42	2,200,000.00	1,968,560.00	
T 3.25 06/30/29	3,000,000.00	2,876,250.00	
T 3.375 05/15/44	500,000.00	451,150.00	
T 3.375 08/15/42	3,000,000.00	2,734,200.00	
T 3.375 11/15/48	3,100,000.00	2,800,292.00	
T 3.5 02/15/39	200,000.00	191,042.00	
T 3.625 02/15/44	600,000.00	563,388.00	
T 3.625 08/15/43	1,000,000.00	941,790.00	
T 3.75 08/15/41	1,100,000.00	1,067,979.00	
T 3.75 11/15/43	700,000.00	670,740.00	
T 3.875 01/15/26	5,300,000.00	5,234,545.00	
T 3.875 08/15/40	500,000.00	496,660.00	
T 3.875 09/30/29	3,500,000.00	3,479,070.00	
T 3.875 12/31/29	1,500,000.00	1,493,190.00	
T 4 10/31/29	1,600,000.00	1,602,496.00	
T 4 11/15/42	2,000,000.00	1,994,060.00	
T 4 11/15/52	3,500,000.00	3,584,210.00	
T 4.125 10/31/27	3,500,000.00	3,506,615.00	
T 4.125 11/15/32	4,600,000.00	4,707,778.00	
T 4.25 05/15/39	100,000.00	104,414.00	
T 4.25 10/15/25	2,000,000.00	1,992,460.00	
T 4.25 11/15/40	600,000.00	624,726.00	
T 4.375 05/15/40	900,000.00	950,832.00	
T 4.375 05/15/41	300,000.00	317,283.00	
T 4.375 11/15/39	300,000.00	317,811.00	
T 4.5 05/15/38	2,000,000.00	2,148,980.00	

	T 4.5 08/15/39	300,000.00	322,371.00	
	T 4.5 11/15/25	3,800,000.00	3,811,780.00	
	T 4.625 02/15/40	1,000,000.00	1,091,090.00	
	T 4.75 02/15/41	900,000.00	997,236.00	
	T 5.25 11/15/28	500,000.00	531,950.00	
	T 5.375 02/15/31	320,000.00	352,566.40	
	T 6 02/15/26	1,000,000.00	1,047,140.00	
	T-BOND 15/11/2027	1,000,000.00	1,087,810.00	
	アメリカ・ドル小計	627,320,000.00	558,368,007.40 (75,072,578,595)	
カナダ・ドル	CAN 0.5 09/01/25	2,700,000.00	2,481,975.00	
	CAN 1 06/01/27	1,100,000.00	996,578.00	
	CAN 1.25 03/01/27	400,000.00	366,328.00	
	CAN 1.25 06/01/30	5,500,000.00	4,781,645.00	
	CAN 1.5 04/01/25	700,000.00	664,342.00	
	CAN 1.5 06/01/26	3,200,000.00	2,995,104.00	
	CAN 1.5 09/01/24	2,200,000.00	2,111,406.00	
	CAN 1.5 12/01/31	2,300,000.00	1,988,718.00	
	CAN 1.75 12/01/53	1,000,000.00	709,100.00	
	CAN 2 06/01/28	700,000.00	656,453.00	
	CAN 2.25 03/01/24	1,000,000.00	977,670.00	
	CAN 2.25 06/01/25	500,000.00	482,495.00	
	CAN 2.25 06/01/29	1,400,000.00	1,320,060.00	
	CAN 2.25 12/01/29	600,000.00	563,364.00	
	CAN 2.5 06/01/24	2,100,000.00	2,051,280.00	
	CAN 2.5 12/01/32	2,300,000.00	2,149,764.00	
	CAN 2.75 12/01/48	1,300,000.00	1,178,918.00	
	CAN 3 10/01/25	300,000.00	293,616.00	
	CAN 3.5 12/01/45	1,200,000.00	1,233,372.00	
	CAN 4 06/01/41	1,100,000.00	1,198,945.00	
	CAN 5 06/01/37	600,000.00	712,242.00	
	CAN 5.75 06/01/29	250,000.00	284,567.50	
	CAN 5.75 06/01/33	400,000.00	483,664.00	
	CANADA 2.75 12/01/64	700,000.00	619,430.00	
	カナダ・ドル小計	33,550,000.00	31,301,036.50 (3,119,148,287)	
オーストラリア・ドル	ACGB 0.25 11/21/25	800,000.00	732,872.00	
	ACGB 1.5 06/21/31	4,700,000.00	3,940,715.00	
	ACGB 1.75 06/21/51	500,000.00	299,485.00	
	ACGB 1.75 11/21/32	1,200,000.00	999,396.00	
	ACGB 2.25 05/21/28	1,300,000.00	1,217,528.00	
	ACGB 2.5 05/21/30	2,600,000.00	2,400,658.00	
	ACGB 2.75 04/21/24	2,500,000.00	2,474,750.00	
	ACGB 2.75 06/21/35	800,000.00	706,552.00	



	ACGB 2.75 11/21/27	1,300,000.00	1,253,850.00	
	ACGB 2.75 11/21/28	200,000.00	191,106.00	
	ACGB 2.75 11/21/29	1,800,000.00	1,700,082.00	
	ACGB 3 03/21/47	1,200,000.00	979,284.00	
	ACGB 3 11/21/33	1,000,000.00	925,770.00	
	ACGB 3.25 04/21/25	1,300,000.00	1,293,591.00	
	ACGB 3.25 04/21/29	800,000.00	782,688.00	
	ACGB 3.25 06/21/39	2,000,000.00	1,793,120.00	
	ACGB 3.75 04/21/37	1,200,000.00	1,162,944.00	
	ACGB 4.25 04/21/26	2,150,000.00	2,198,246.00	
	ACGB 4.5 04/21/33	900,000.00	951,264.00	
	オーストラリア・ドル小計	28,250,000.00	26,003,901.00 (2,400,940,179)	
シンガ ポール・ ドル	SIGB 1.25 11/01/26	600,000.00	560,712.00	
	SIGB 1.625 07/01/31	1,000,000.00	881,850.00	
	SIGB 2.25 08/01/36	800,000.00	714,416.00	
	SIGB 2.625 05/01/28	800,000.00	780,312.00	
	SIGB 2.75 03/01/46	800,000.00	770,104.00	
	SIGB 2.75 04/01/42	700,000.00	669,501.00	
	SIGB 2.875 09/01/30	200,000.00	195,136.00	
	SIGB 3 09/01/24	1,000,000.00	995,970.00	
	SIGB 3.375 09/01/33	300,000.00	303,555.00	
	SIGB 3.5 03/01/27	1,100,000.00	1,113,409.00	
	シンガポール・ドル小計	7,300,000.00	6,984,965.00 (702,338,231)	
ニュー ジーラン ド・ドル	NZGB 1.75 05/15/41	500,000.00	325,610.00	
	NZGB 2 05/15/32	500,000.00	412,260.00	
	NZGB 2.75 04/15/25	1,100,000.00	1,058,024.00	
	NZGB 2.75 05/15/51	500,000.00	363,730.00	
	NZGB 3 04/20/29	600,000.00	557,796.00	
	NZGB 4.5 04/15/27	1,100,000.00	1,106,226.00	
	ニュージーランド・ドル小計	4,300,000.00	3,823,646.00 (320,192,116)	
イギリ ス・ボン ド	UK TSY GILT	400,000.00	267,032.00	
	UKT 0.125 01/30/26	1,300,000.00	1,182,610.00	
	UKT 0.125 01/31/28	500,000.00	424,710.00	
	UKT 0.25 01/31/25	700,000.00	654,178.00	
	UKT 0.25 07/31/31	1,300,000.00	989,235.00	
	UKT 0.375 10/22/26	1,200,000.00	1,071,948.00	
	UKT 0.375 10/22/30	1,800,000.00	1,424,880.00	
	UKT 0.5 01/31/29	1,800,000.00	1,508,184.00	
	UKT 0.5 10/22/61	900,000.00	312,705.00	
	UKT 0.625 06/07/25	2,900,000.00	2,723,535.00	
	UKT 0.625 07/31/35	2,100,000.00	1,448,160.00	

UKT 0.875 10/22/29	500,000.00	423,790.00	
UKT 1 01/31/32	1,900,000.00	1,525,909.00	
UKT 1 04/22/24	600,000.00	581,118.00	
UKT 1.125 10/22/73	300,000.00	128,280.00	
UKT 1.25 07/22/27	200,000.00	182,186.00	
UKT 1.25 07/31/51	500,000.00	270,635.00	
UKT 1.5 07/22/26	1,100,000.00	1,031,910.00	
UKT 1.5 07/22/47	2,000,000.00	1,223,580.00	
UKT 1.625 10/22/28	300,000.00	272,253.00	
UKT 1.625 10/22/54	500,000.00	293,500.00	
UKT 1.75 01/22/49	1,250,000.00	801,437.50	
UKT 1.75 09/07/37	100,000.00	76,258.00	
UKT 2 09/07/25	1,100,000.00	1,061,830.00	
UKT 2.5 07/22/65	1,600,000.00	1,173,344.00	
UKT 2.75 09/07/24	900,000.00	886,545.00	
UKT 3.25 01/22/44	1,600,000.00	1,427,824.00	
UKT 3.25 01/31/33	300,000.00	290,085.00	
UKT 3.5 01/22/45	1,250,000.00	1,155,225.00	
UKT 3.5 07/22/68	1,300,000.00	1,226,017.00	
UKT 3.75 01/29/38	600,000.00	587,460.00	
UKT 3.75 07/22/52	1,200,000.00	1,156,332.00	
UKT 4 01/22/60	1,300,000.00	1,344,824.00	
UKT 4.125 01/29/27	1,300,000.00	1,322,282.00	
UKT 4.25 03/07/36	900,000.00	939,969.00	
UKT 4.25 06/07/32	500,000.00	528,205.00	
UKT 4.25 09/07/39	600,000.00	620,598.00	
UKT 4.25 12/07/27	900,000.00	931,716.00	
UKT 4.25 12/07/40	600,000.00	620,520.00	
UKT 4.25 12/07/46	1,500,000.00	1,549,650.00	
UKT 4.25 12/07/49	900,000.00	936,396.00	
UKT 4.25 12/07/55	1,700,000.00	1,804,074.00	
UKT 4.5 09/07/34	1,100,000.00	1,182,313.00	
UKT 4.5 12/07/42	1,050,000.00	1,124,025.00	
UKT 4.75 12/07/30	1,150,000.00	1,249,751.00	
UKT 4.75 12/07/38	1,000,000.00	1,096,260.00	
UKT 5 03/07/25	1,300,000.00	1,337,258.00	
UKT 6 12/07/28	650,000.00	734,168.50	
イギリス・ボンド小計	50,450,000.00	45,104,705.00 (7,289,371,375)	
イスラエル・シュケル	ILGOV 0.4 10/31/24	1,800,000.00	1,694,070.00
	ILGOV 0.5 04/30/25	4,600,000.00	4,269,720.00
	ILGOV 1 03/31/30	700,000.00	584,227.00
	ILGOV 2.25 09/28/28	500,000.00	462,085.00
	ILGOV 3.75 03/31/47	3,700,000.00	3,699,704.00

	ILGOV 6.25 10/30/26	2,600,000.00	2,810,158.00	
イスラエル・シュケル小計		13,900,000.00	13,519,964.00 (512,997,458)	
デンマーク・クローネ	DGB 0 11/15/31	500,000.00	399,195.00	
	DGB 0.25 11/15/52	1,800,000.00	974,214.00	
	DGB 0.5 11/15/27	8,000,000.00	7,244,000.00	
	DGB 0.5 11/15/29	5,400,000.00	4,698,864.00	
	DGB 1.75 11/15/25	2,400,000.00	2,332,344.00	
	DGB 4.5 11/15/39	8,000,000.00	9,988,800.00	
デンマーク・クローネ小計		26,100,000.00	25,637,417.00 (494,289,400)	
ノルウェー・クローネ	NGB 1.375 08/19/30	4,200,000.00	3,688,314.00	
	NGB 1.5 02/19/26	3,000,000.00	2,848,050.00	
	NGB 1.75 02/17/27	200,000.00	189,044.00	
	NGB 1.75 03/13/25	3,000,000.00	2,903,430.00	
	NGB 1.75 09/06/29	5,000,000.00	4,570,000.00	
	NGB 2 04/26/28	5,900,000.00	5,554,791.00	
	NGB 3 03/14/24	2,800,000.00	2,786,224.00	
ノルウェー・クローネ小計		24,100,000.00	22,539,853.00 (293,919,683)	
スウェーデン・クローナ	SGB 0.125 05/12/31	500,000.00	416,465.00	
	SGB 0.75 05/12/28	3,700,000.00	3,393,344.00	
	SGB 0.75 11/12/29	3,700,000.00	3,325,042.00	
	SGB 1 11/12/26	6,200,000.00	5,855,280.00	
	SGB 2.5 05/12/25	5,000,000.00	4,962,050.00	
	SGB 3.5 03/30/39	4,600,000.00	5,269,024.00	
スウェーデン・クローナ小計		23,700,000.00	23,221,205.00 (298,160,272)	
メキシコ・ペソ	MBONO 10 12/05/24	32,000,000.00	31,737,920.00	
	MBONO 5 03/06/25	12,000,000.00	10,764,480.00	
	MBONO 5.75 03/05/26	19,000,000.00	16,918,930.00	
	MBONO 7.5 05/26/33	3,000,000.00	2,717,160.00	
	MBONO 7.5 06/03/27	16,000,000.00	14,924,800.00	
	MBONO 7.75 05/29/31	21,000,000.00	19,497,660.00	
	MBONO 7.75 11/23/34	18,000,000.00	16,424,460.00	
	MBONO 8 11/07/47	5,000,000.00	4,488,800.00	
	MBONO 8.5 05/31/29	21,000,000.00	20,434,260.00	
	MBONO 8.5 11/18/38	40,000,000.00	38,010,000.00	
メキシコ・ペソ小計		187,000,000.00	175,918,470.00 (1,287,371,363)	
オフショア・人民元	CGB 2.18 08/25/25	26,000,000.00	25,803,700.00	
	CGB 2.24 05/25/25	31,000,000.00	30,862,670.00	
	CGB 2.26 02/24/25	22,000,000.00	21,925,860.00	
	CGB 2.47 09/02/24	26,000,000.00	26,048,880.00	
	CGB 2.48 04/15/27	9,000,000.00	8,929,350.00	

	CGB 2.5 07/25/27	16,000,000.00	15,876,000.00	
	CGB 2.62 09/25/29	14,000,000.00	13,806,660.00	
	CGB 2.64 01/15/28	2,000,000.00	1,995,680.00	
	CGB 2.69 08/12/26	51,000,000.00	51,145,350.00	
	CGB 2.8 03/24/29	26,000,000.00	25,975,820.00	
	CGB 2.8 11/15/32	13,000,000.00	12,898,990.00	
	CGB 2.91 10/14/28	21,000,000.00	21,163,800.00	
	CGB 3.02 05/27/31	43,000,000.00	43,551,260.00	
	CGB 3.72 04/12/51	35,000,000.00	37,550,450.00	
	オフショア・人民元小計	335,000,000.00	337,534,470.00 (6,592,081,954)	
マレーシ ア・リン ギット	MALAYSIA GOVT	700,000.00	702,324.00	
	MALAYSIA GOVT	1,500,000.00	1,513,785.00	
	MALAYSIA GOVT	1,300,000.00	1,315,600.00	
	MALAYSIA GOVT	1,400,000.00	1,310,610.00	
	MGS 3.502 05/31/27	5,100,000.00	5,065,065.00	
	MGS 3.955 09/15/25	3,200,000.00	3,234,240.00	
	MGS 4.498 04/15/30	6,400,000.00	6,687,232.00	
	MGS 4.736 03/15/46	6,700,000.00	7,056,306.00	
	マレーシア・リングギット小計	26,300,000.00	26,885,162.00 (816,583,025)	
ポーラ ンド・ズ ロ チ	POLGB 0.25 10/25/26	7,000,000.00	5,610,500.00	
	POLGB 0.75 04/25/25	1,800,000.00	1,599,840.00	
	POLGB 1.25 10/25/30	7,800,000.00	5,427,318.00	
	POLGB 2.25 10/25/24	8,000,000.00	7,498,720.00	
	POLGB 2.75 04/25/28	2,200,000.00	1,854,534.00	
	ポーランド・ズロチ小計	26,800,000.00	21,990,912.00 (663,199,725)	
ユーロ	BGB 0 10/22/31	2,000,000.00	1,551,200.00	
	BGB 0.1 06/22/30	200,000.00	164,112.00	
	BGB 0.35 06/22/32	300,000.00	235,515.00	
	BGB 0.4 06/22/40	300,000.00	185,859.00	
	BGB 0.5 10/22/24	1,300,000.00	1,249,534.00	
	BGB 0.65 06/22/71	400,000.00	164,092.00	
	BGB 0.8 06/22/25	300,000.00	286,221.00	
	BGB 0.8 06/22/27	800,000.00	736,040.00	
	BGB 0.8 06/22/28	1,600,000.00	1,445,872.00	
	BGB 0.9 06/22/29	900,000.00	801,603.00	
	BGB 1 06/22/26	1,800,000.00	1,698,984.00	
	BGB 1 06/22/31	1,300,000.00	1,117,142.00	
	BGB 1.25 04/22/33	1,100,000.00	930,061.00	
	BGB 1.45 06/22/37	400,000.00	318,852.00	
	BGB 1.6 06/22/47	650,000.00	463,957.00	
BGB 1.7 06/22/50	500,000.00	355,590.00		

BGB 1.9 06/22/38	1,000,000.00	836,820.00	
BGB 2.15 06/22/66	500,000.00	380,015.00	
BGB 2.25 06/22/57	500,000.00	394,610.00	
BGB 2.6 06/22/24	400,000.00	397,664.00	
BGB 3 06/22/34	200,000.00	197,098.00	
BGB 3.75 06/22/45	800,000.00	850,544.00	
BGB 4 03/28/32	300,000.00	323,286.00	
BGB 4.25 03/28/41	1,000,000.00	1,125,830.00	
BGB 4.5 03/28/26	700,000.00	735,280.00	
BGB 5 03/28/35	1,000,000.00	1,180,750.00	
BGB 5.5 03/28/28	1,000,000.00	1,127,790.00	
BTPS	2,400,000.00	2,283,768.00	
BTPS 0 12/15/24	1,300,000.00	1,223,807.00	
BTPS 0.35 02/01/25	2,400,000.00	2,265,096.00	
BTPS 0.5 02/01/26	1,000,000.00	917,360.00	
BTPS 0.85 01/15/27	1,700,000.00	1,534,879.00	
BTPS 0.9 04/01/31	2,000,000.00	1,578,480.00	
BTPS 0.95 06/01/32	2,100,000.00	1,597,071.00	
BTPS 0.95 08/01/30	1,800,000.00	1,456,074.00	
BTPS 0.95 09/15/27	800,000.00	711,736.00	
BTPS 0.95 12/01/31	2,600,000.00	2,011,464.00	
BTPS 1.1 04/01/27	3,000,000.00	2,720,550.00	
BTPS 1.25 12/01/26	800,000.00	736,320.00	
BTPS 1.45 03/01/36	400,000.00	288,628.00	
BTPS 1.45 05/15/25	700,000.00	672,308.00	
BTPS 1.45 11/15/24	1,800,000.00	1,743,552.00	
BTPS 1.5 06/01/25	1,900,000.00	1,823,297.00	
BTPS 1.6 06/01/26	1,200,000.00	1,130,412.00	
BTPS 1.65 12/01/30	2,200,000.00	1,862,278.00	
BTPS 1.7 09/01/51	1,500,000.00	878,340.00	
BTPS 1.85 05/15/24	700,000.00	687,743.00	
BTPS 1.85 07/01/25	1,000,000.00	965,630.00	
BTPS 2 02/01/28	3,200,000.00	2,965,120.00	
BTPS 2 12/01/25	1,300,000.00	1,251,185.00	
BTPS 2.05 08/01/27	1,500,000.00	1,405,650.00	
BTPS 2.1 07/15/26	1,000,000.00	955,290.00	
BTPS 2.2 06/01/27	900,000.00	851,760.00	
BTPS 2.25 09/01/36	500,000.00	396,650.00	
BTPS 2.45 09/01/33	600,000.00	509,406.00	
BTPS 2.45 09/01/50	900,000.00	631,854.00	
BTPS 2.5 11/15/25	1,200,000.00	1,171,680.00	
BTPS 2.5 12/01/24	1,300,000.00	1,282,294.00	
BTPS 2.7 03/01/47	1,550,000.00	1,177,380.00	
BTPS 2.8 03/01/67	1,000,000.00	696,940.00	

BTPS 2.8 06/15/29	1,000,000.00	942,260.00	
BTPS 2.8 12/01/28	1,600,000.00	1,525,456.00	
BTPS 2.95 09/01/38	600,000.00	506,670.00	
BTPS 3 08/01/29	3,100,000.00	2,962,267.00	
BTPS 3.1 03/01/40	500,000.00	423,110.00	
BTPS 3.25 09/01/46	1,600,000.00	1,342,320.00	
BTPS 3.35 03/01/35	850,000.00	770,907.50	
BTPS 3.45 03/01/48	1,000,000.00	864,400.00	
BTPS 3.5 03/01/30	2,000,000.00	1,959,200.00	
BTPS 3.75 09/01/24	2,300,000.00	2,312,972.00	
BTPS 3.85 09/01/49	1,500,000.00	1,374,015.00	
BTPS 3.85 12/15/29	300,000.00	298,707.00	
BTPS 4 02/01/37	2,600,000.00	2,521,428.00	
BTPS 4.5 03/01/24	1,000,000.00	1,011,690.00	
BTPS 4.5 03/01/26	1,300,000.00	1,337,453.00	
BTPS 4.75 09/01/28	2,000,000.00	2,104,720.00	
BTPS 4.75 09/01/44	900,000.00	940,788.00	
BTPS 5 03/01/25	1,000,000.00	1,031,400.00	
BTPS 5 08/01/34	2,070,000.00	2,194,903.80	
BTPS 5 08/01/39	1,800,000.00	1,926,144.00	
BTPS 5 09/01/40	1,700,000.00	1,824,984.00	
BTPS 5.75 02/01/33	1,700,000.00	1,907,995.00	
BTPS 6 05/01/31	2,200,000.00	2,519,550.00	
BTPS 6.5 11/01/27	1,700,000.00	1,913,673.00	
BTPS 7.25 11/01/26	400,000.00	452,228.00	
DBR 0 02/15/30	800,000.00	677,040.00	
DBR 0 02/15/32	3,200,000.00	2,583,040.00	
DBR 0 05/15/35	3,600,000.00	2,654,136.00	
DBR 0 08/15/29	2,500,000.00	2,140,125.00	
DBR 0 08/15/30	5,800,000.00	4,855,876.00	
DBR 0 08/15/31	2,300,000.00	1,882,757.00	
DBR 0 08/15/50	3,000,000.00	1,589,250.00	
DBR 0 11/15/27	1,300,000.00	1,156,896.00	
DBR 0.25 02/15/27	2,300,000.00	2,103,465.00	
DBR 0.25 02/15/29	1,800,000.00	1,582,830.00	
DBR 0.25 08/15/28	1,500,000.00	1,331,970.00	
DBR 0.5 02/15/25	2,500,000.00	2,390,125.00	
DBR 0.5 02/15/26	3,100,000.00	2,911,613.00	
DBR 0.5 02/15/28	1,800,000.00	1,635,426.00	
DBR 0.5 08/15/27	2,300,000.00	2,107,559.00	
DBR 1 05/15/38	1,000,000.00	807,110.00	
DBR 1 08/15/24	1,300,000.00	1,264,588.00	
DBR 1 08/15/25	1,300,000.00	1,245,894.00	
DBR 1.25 08/15/48	1,450,000.00	1,141,411.00	

DBR 1.5 05/15/24	1,200,000.00	1,179,672.00	
DBR 1.75 02/15/24	2,200,000.00	2,174,744.00	
DBR 1.8 08/15/53	200,000.00	173,946.00	
DBR 2.3 02/15/33	200,000.00	197,214.00	
DBR 2.5 07/04/44	1,900,000.00	1,914,630.00	
DBR 2.5 08/15/46	2,700,000.00	2,741,931.00	
DBR 3.25 07/04/42	700,000.00	779,856.00	
DBR 4 01/04/37	1,300,000.00	1,523,769.00	
DBR 4.25 07/04/39	700,000.00	862,729.00	
DBR 4.75 07/04/28	1,600,000.00	1,781,632.00	
DBR 4.75 07/04/34	600,000.00	734,988.00	
DBR 4.75 07/04/40	1,450,000.00	1,901,646.00	
DBR 5.5 01/04/31	900,000.00	1,095,615.00	
DBR 5.625 01/04/28	1,000,000.00	1,142,070.00	
DBR 6.25 01/04/30	500,000.00	619,595.00	
DBR 6.5 07/04/27	1,000,000.00	1,161,590.00	
FRTR 0 02/25/24	400,000.00	388,140.00	
FRTR 0 02/25/25	3,000,000.00	2,829,540.00	
FRTR 0 02/25/26	3,800,000.00	3,491,592.00	
FRTR 0 03/25/24	4,800,000.00	4,647,936.00	
FRTR 0 03/25/25	1,900,000.00	1,787,824.00	
FRTR 0 05/25/32	1,900,000.00	1,460,359.00	
FRTR 0 11/25/29	4,500,000.00	3,739,095.00	
FRTR 0 11/25/30	3,900,000.00	3,147,417.00	
FRTR 0 11/25/31	3,000,000.00	2,346,240.00	
FRTR 0.25 11/25/26	2,900,000.00	2,638,942.00	
FRTR 0.5 05/25/25	1,300,000.00	1,232,296.00	
FRTR 0.5 05/25/26	3,500,000.00	3,249,680.00	
FRTR 0.5 05/25/29	2,300,000.00	2,002,518.00	
FRTR 0.5 05/25/72	100,000.00	38,327.00	
FRTR 0.5 06/25/44	1,200,000.00	710,076.00	
FRTR 0.75 02/25/28	800,000.00	723,944.00	
FRTR 0.75 05/25/28	3,300,000.00	2,974,983.00	
FRTR 0.75 05/25/52	3,000,000.00	1,637,340.00	
FRTR 0.75 11/25/28	4,000,000.00	3,571,200.00	
FRTR 1 05/25/27	1,800,000.00	1,672,668.00	
FRTR 1 11/25/25	1,300,000.00	1,237,366.00	
FRTR 1.25 05/25/34	1,200,000.00	999,276.00	
FRTR 1.25 05/25/36	3,700,000.00	2,957,595.00	
FRTR 1.25 05/25/38	200,000.00	154,082.00	
FRTR 1.5 05/25/31	3,050,000.00	2,764,794.50	
FRTR 1.5 05/25/50	2,400,000.00	1,671,144.00	
FRTR 1.75 05/25/66	800,000.00	549,104.00	
FRTR 1.75 06/25/39	3,200,000.00	2,645,888.00	

FRTR 1.75 11/25/24	2,600,000.00	2,546,726.00	
FRTR 2 05/25/48	2,000,000.00	1,589,120.00	
FRTR 2 11/25/32	3,000,000.00	2,768,790.00	
FRTR 2.25 05/25/24	1,700,000.00	1,684,003.00	
FRTR 2.5 05/25/30	3,100,000.00	3,046,153.00	
FRTR 2.75 10/25/27	3,850,000.00	3,844,841.00	
FRTR 3.25 05/25/45	900,000.00	906,345.00	
FRTR 3.5 04/25/26	1,800,000.00	1,836,414.00	
FRTR 4 04/25/55	1,370,000.00	1,577,993.40	
FRTR 4 04/25/60	1,400,000.00	1,642,858.00	
FRTR 4 10/25/38	2,000,000.00	2,200,640.00	
FRTR 4.5 04/25/41	2,100,000.00	2,466,954.00	
FRTR 4.75 04/25/35	800,000.00	933,632.00	
FRTR 5.5 04/25/29	1,650,000.00	1,899,793.50	
FRTR 5.75 10/25/32	400,000.00	495,548.00	
FRTR 6 10/25/25	2,100,000.00	2,267,055.00	
IRISH 0 10/18/31	500,000.00	390,365.00	
IRISH 0.9 05/15/28	500,000.00	455,380.00	
IRISH 1 05/15/26	800,000.00	757,984.00	
IRISH 1.1 05/15/29	500,000.00	451,870.00	
IRISH 1.3 05/15/33	800,000.00	680,704.00	
IRISH 1.35 03/18/31	500,000.00	447,110.00	
IRISH 1.5 05/15/50	500,000.00	347,865.00	
IRISH 1.7 05/15/37	300,000.00	250,314.00	
IRISH 2 02/18/45	1,100,000.00	887,172.00	
IRISH 2.4 05/15/30	600,000.00	584,676.00	
IRISH 3.4 03/18/24	500,000.00	502,975.00	
IRISH 5.4 03/13/25	800,000.00	840,656.00	
NETHER 0 01/15/27	1,300,000.00	1,171,300.00	
NETHER 0 07/15/30	2,600,000.00	2,139,462.00	
NETHER 0.25 07/15/25	1,100,000.00	1,035,342.00	
NETHER 0.25 07/15/29	1,000,000.00	860,470.00	
NETHER 0.5 01/15/40	1,700,000.00	1,188,198.00	
NETHER 0.5 07/15/26	1,700,000.00	1,578,331.00	
NETHER 0.5 07/15/32	200,000.00	163,628.00	
NETHER 0.75 07/15/27	400,000.00	368,544.00	
NETHER 0.75 07/15/28	1,500,000.00	1,357,515.00	
NETHER 2 07/15/24	700,000.00	690,627.00	
NETHER 2.5 01/15/33	600,000.00	587,880.00	
NETHER 2.75 01/15/47	1,900,000.00	1,933,421.00	
NETHER 3.75 01/15/42	1,300,000.00	1,487,512.00	
NETHER 4 01/15/37	1,000,000.00	1,137,290.00	
NETHER 5.5 01/15/28	700,000.00	789,446.00	
OBL 0 04/05/24	1,300,000.00	1,258,712.00	



OBL 0 04/11/25	2,800,000.00	2,639,448.00	
OBL 0 04/16/27	4,200,000.00	3,783,696.00	
OBL 0 10/09/26	1,100,000.00	1,002,320.00	
OBL 0 10/10/25	2,600,000.00	2,423,512.00	
OBL 0 10/18/24	1,000,000.00	954,000.00	
OBL 2.2 04/13/28	300,000.00	295,386.00	
RAGB 0 02/20/30	900,000.00	735,165.00	
RAGB 0 02/20/31	1,400,000.00	1,108,716.00	
RAGB 0 04/20/25	300,000.00	281,928.00	
RAGB 0.5 02/20/29	550,000.00	478,439.50	
RAGB 0.5 04/20/27	700,000.00	637,686.00	
RAGB 0.75 02/20/28	900,000.00	813,708.00	
RAGB 0.75 03/20/51	900,000.00	519,822.00	
RAGB 0.75 10/20/26	1,300,000.00	1,207,271.00	
RAGB 0.85 06/30/20	150,000.00	61,263.00	
RAGB 0.9 02/20/32	500,000.00	417,645.00	
RAGB 1.2 10/20/25	1,000,000.00	959,550.00	
RAGB 1.5 02/20/47	700,000.00	514,941.00	
RAGB 1.5 11/02/86	200,000.00	120,542.00	
RAGB 1.65 10/21/24	800,000.00	783,592.00	
RAGB 2.4 05/23/34	900,000.00	842,778.00	
RAGB 3.15 06/20/44	500,000.00	504,485.00	
RAGB 3.8 01/26/62	700,000.00	814,170.00	
RAGB 4.15 03/15/37	300,000.00	334,329.00	
RAGB 4.85 03/15/26	200,000.00	212,308.00	
RAGB 6.25 07/15/27	1,000,000.00	1,138,890.00	
RFGB 0 09/15/30	400,000.00	321,780.00	
RFGB 0.25 09/15/40	400,000.00	246,452.00	
RFGB 0.5 04/15/26	700,000.00	654,248.00	
RFGB 0.5 09/15/28	400,000.00	351,564.00	
RFGB 0.5 09/15/29	800,000.00	687,872.00	
RFGB 0.75 04/15/31	500,000.00	421,705.00	
RFGB 1.375 04/15/47	500,000.00	366,700.00	
RFGB 2 04/15/24	900,000.00	891,153.00	
RFGB 2.625 07/04/42	800,000.00	751,768.00	
RFGB 2.75 07/04/28	200,000.00	199,340.00	
RFGB 4 07/04/25	300,000.00	308,994.00	
SPGB 0 01/31/25	500,000.00	471,640.00	
SPGB 0 05/31/25	200,000.00	186,478.00	
SPGB 0.25 07/30/24	1,400,000.00	1,345,428.00	
SPGB 0.5 04/30/30	600,000.00	497,250.00	
SPGB 0.5 10/31/31	1,400,000.00	1,105,468.00	
SPGB 0.7 04/30/32	2,200,000.00	1,742,752.00	
SPGB 0.8 07/30/27	1,700,000.00	1,539,724.00	

SPGB 1 10/31/50	300,000.00	159,732.00	
SPGB 1.2 10/31/40	1,700,000.00	1,139,459.00	
SPGB 1.25 10/31/30	3,000,000.00	2,595,540.00	
SPGB 1.3 10/31/26	3,100,000.00	2,915,054.00	
SPGB 1.4 04/30/28	1,600,000.00	1,468,688.00	
SPGB 1.4 07/30/28	2,200,000.00	2,012,230.00	
SPGB 1.45 04/30/29	2,100,000.00	1,899,702.00	
SPGB 1.45 10/31/27	1,100,000.00	1,021,482.00	
SPGB 1.45 10/31/71	400,000.00	191,536.00	
SPGB 1.5 04/30/27	1,500,000.00	1,409,040.00	
SPGB 1.6 04/30/25	1,400,000.00	1,357,678.00	
SPGB 1.85 07/30/35	2,000,000.00	1,652,980.00	
SPGB 1.95 04/30/26	2,000,000.00	1,933,180.00	
SPGB 1.95 07/30/30	1,700,000.00	1,556,911.00	
SPGB 2.15 10/31/25	1,600,000.00	1,564,656.00	
SPGB 2.35 07/30/33	700,000.00	632,527.00	
SPGB 2.55 10/31/32	700,000.00	650,349.00	
SPGB 2.7 10/31/48	750,000.00	619,192.50	
SPGB 2.75 10/31/24	2,100,000.00	2,091,096.00	
SPGB 2.9 10/31/46	1,700,000.00	1,478,235.00	
SPGB 3.45 07/30/66	1,300,000.00	1,182,220.00	
SPGB 3.8 04/30/24	1,400,000.00	1,412,684.00	
SPGB 4.2 01/31/37	1,050,000.00	1,110,133.50	
SPGB 4.65 07/30/25	800,000.00	829,568.00	
SPGB 4.7 07/30/41	1,500,000.00	1,687,350.00	
SPGB 4.8 01/31/24	2,200,000.00	2,235,816.00	
SPGB 4.9 07/30/40	1,200,000.00	1,375,476.00	
SPGB 5.15 10/31/28	1,500,000.00	1,652,400.00	
SPGB 5.15 10/31/44	1,400,000.00	1,687,112.00	
SPGB 5.75 07/30/32	1,000,000.00	1,195,340.00	
SPGB 5.9 07/30/26	500,000.00	545,675.00	
SPGB 6 01/31/29	1,900,000.00	2,190,396.00	
ユーロ小計	378,840,000.00	349,104,628.20 (50,106,987,287)	
国債証券合計		149,970,158,950 (149,970,158,950)	
合計		149,970,158,950 (149,970,158,950)	

(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	210銘柄	49.5%	50.1%
カナダ・ドル	国債証券	24銘柄	2.1%	2.1%
オーストラリア・ドル	国債証券	19銘柄	1.6%	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	48銘柄	4.8%	4.9%
イスラエル・シケル	国債証券	6銘柄	0.3%	0.3%
デンマーク・クローネ	国債証券	6銘柄	0.3%	0.3%
ノルウェー・クローネ	国債証券	7銘柄	0.2%	0.2%
スウェーデン・クローナ	国債証券	6銘柄	0.2%	0.2%
メキシコ・ペソ	国債証券	10銘柄	0.8%	0.9%
オフショア・人民元	国債証券	14銘柄	4.3%	4.4%
マレーシア・リングギット	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	268銘柄	33.1%	33.4%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## 三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）

2023年3月31日現在

資産総額	728,128,782円
負債総額	213,280円
純資産総額（ - ）	727,915,502円
発行済口数	646,662,156口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	1.1257円 (11,257円)

## 三井住友DS・年金バランス50（標準型）

2023年3月31日現在

資産総額	2,270,600,494円
負債総額	1,109,353円
純資産総額（ - ）	2,269,491,141円
発行済口数	1,841,391,610口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	1.2325円 (12,325円)

## 三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）

2023年3月31日現在

資産総額	1,527,743,559円
負債総額	270,127円
純資産総額（ - ）	1,527,473,432円
発行済口数	1,137,077,599口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	1.3433円 (13,433円)

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

## イ 名義書換

該当事項はありません。

## ロ 受益者名簿

作成しません。

## 八 受益者に対する特典

ありません。

## 二 受益権の譲渡および譲渡制限等

### (イ) 受益権の譲渡

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

### (ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

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

## ホ 受益権の再分割

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

## ヘ 償還金

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

## ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### イ 資本金の額および株式数

	2023年3月31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。

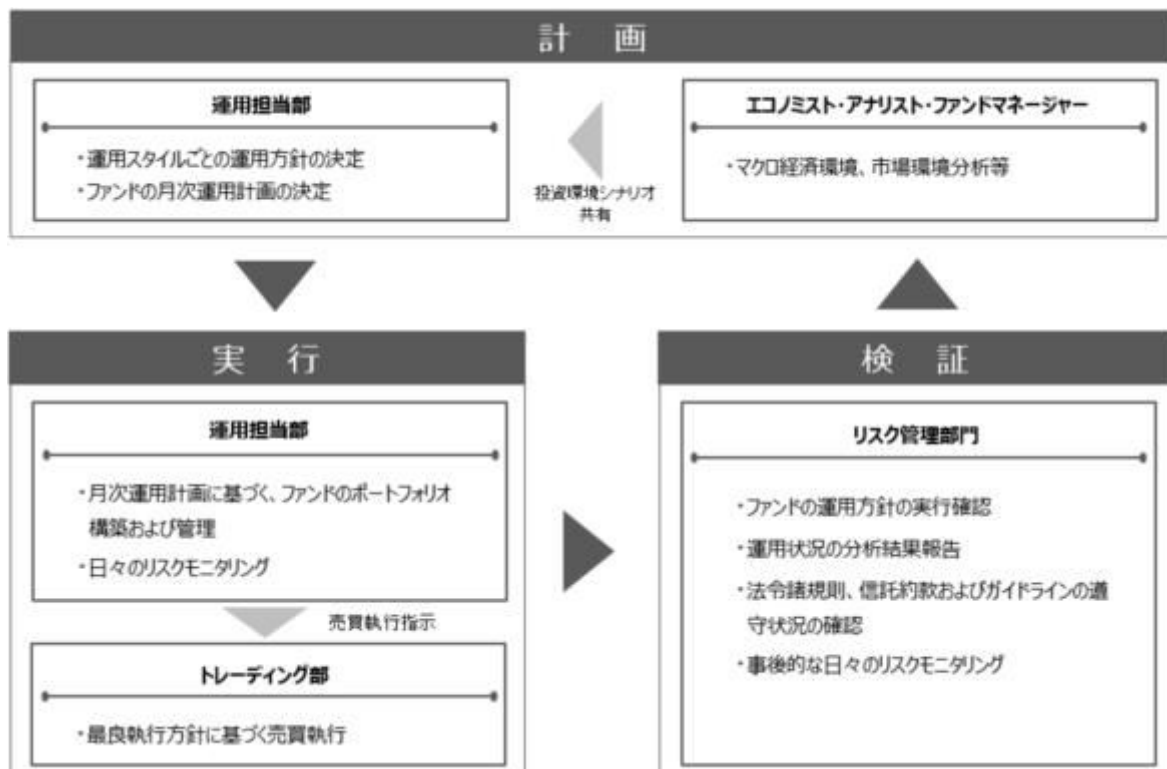
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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。

2023年3月31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	704	9,454,549
単位型株式投資信託	96	567,793
追加型公社債投資信託	1	23,746
単位型公社債投資信託	172	279,956
合計	973	10,326,045

### 3【委託会社等の経理状況】

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

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

なお、当中間会計期間(2022年4月1日から2022年9月30日まで)は、改正府令附則第3条第1項ただし書きにより、改正後の中間財務諸表等規則に基づいて作成しております。

2 当社は、第37期(2021年4月1日から2022年3月31日まで)の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けており、第38期中間会計期間(2022年4月1日から2022年9月30日まで)の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

#### (1)【貸借対照表】

	(単位:千円)	
	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	33,048,142	49,008,279
顧客分別金信託	300,036	300,041
前払費用	449,748	475,266
未収入金	132,419	103,809
未収委託者報酬	9,936,096	12,125,117
未収運用受託報酬	2,247,156	2,437,063
未収投資助言報酬	398,108	388,639
未収収益	39,975	36,700

その他の流動資産		6,981	18,458
流動資産合計		46,558,665	64,893,375
固定資産			
有形固定資産	1		
建物		1,509,450	1,433,442
器具備品		870,855	653,985
土地		710	710
リース資産		13,483	7,357
建設仮勘定		-	5,500
有形固定資産合計		2,394,500	2,100,996
無形固定資産			
ソフトウェア		1,347,889	2,766,476
ソフトウェア仮勘定		1,029,033	100,616
のれん		3,654,491	3,349,950
顧客関連資産		15,671,890	13,558,615
電話加入権		12,727	12,716
商標権		48	42
無形固定資産合計		21,716,080	19,788,417
投資その他の資産			
投資有価証券		22,866,282	14,212,354
関係会社株式		11,246,398	11,246,398
長期差入保証金		1,409,091	1,414,646
長期前払費用		116,117	77,936
会員権		90,479	90,479
貸倒引当金		20,750	20,750
投資その他の資産合計		35,707,619	27,021,065
固定資産合計		59,818,200	48,910,479
資産合計		106,376,866	113,803,855

(単位：千円)

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



負債合計	21,331,554	25,291,730
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
その他資本剰余金	81,927,000	73,466,962
資本剰余金合計	90,555,984	82,095,946
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	-
別途積立金	1,476,959	-
繰越利益剰余金	10,281,242	3,834,794
利益剰余金合計	8,460,037	4,119,040
株主資本計	84,095,946	88,214,986
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	949,365	297,138
評価・換算差額等合計	949,365	297,138
純資産合計	85,045,311	88,512,124
負債・純資産合計	106,376,866	113,803,855

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自	2020年4月1日	(自	2021年4月1日
	至	2021年3月31日)	至	2022年3月31日)
営業収益				
委託者報酬		50,610,457		66,139,024
運用受託報酬		9,450,169		9,652,634
投資助言報酬		1,270,584		1,256,334
その他営業収益				
サービス支 hands 手数料		200,807		199,046
その他		32,820		32,936
営業収益計		61,564,839		77,279,976
営業費用				
支払手数料		22,784,919		30,522,133
広告宣伝費		365,317		330,161
調査費				
調査費		3,061,987		3,196,921
委託調査費		7,810,157		12,192,048
営業雑経費				
通信費		95,163		67,600
印刷費		554,920		494,834
協会費		40,044		34,433
諸会費		29,473		30,488
情報機器関連費		4,562,612		4,767,504
販売促進費		23,614		31,930
その他		163,332		181,301
営業費用合計		39,491,542		51,849,358
一般管理費				
給料				

役員報酬	277,027	263,893
給料・手当	9,280,730	8,664,828
賞与	950,630	991,916
賞与引当金繰入額	1,501,855	2,100,323
交際費	11,815	12,301
寄付金	949	29,273
事務委託費	844,255	1,422,189
旅費交通費	21,023	16,863
租税公課	389,819	476,729
不動産賃借料	1,639,529	1,289,256
退職給付費用	790,144	632,559
固定資産減価償却費	3,040,894	3,133,951
のれん償却費	2,645,986	304,540
諸経費	608,206	256,994
一般管理費合計	22,002,869	19,595,622
営業利益	70,426	5,834,995

(単位：千円)

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

法人税等合計	855,980	2,135,809
当期純利益又は 当期純損失（ ）	28,934,237	4,119,040

## （ 3 ）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	21,185,470	113,741,454	377,855	377,855	114,119,309
当期変動額					
剰余金の配当	711,271	711,271			711,271
当期純損失（ ）	28,934,237	28,934,237			28,934,237
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）			571,510	571,510	571,510
当期変動額合計	29,645,508	29,645,508	571,510	571,510	29,073,997
当期末残高	8,460,037	84,095,946	949,365	949,365	85,045,311

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本							
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			
		資本準備金	その他資本 剰余金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金		
					配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金	
当期首残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	10,281,242
当期変動額								
剰余金の配当								
欠損填補			8,460,037	8,460,037				8,460,037
当期純利益								4,119,040

任意積立金の取崩						60,000	1,476,959	1,536,959
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）								
当期変動額合計	-	-	8,460,037	8,460,037	-	60,000	1,476,959	14,116,037
当期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	-	-	3,834,794

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	8,460,037	84,095,946	949,365	949,365	85,045,311
当期変動額					
剰余金の配当					
欠損填補	8,460,037	-			-
当期純利益	4,119,040	4,119,040			4,119,040
任意積立金の取崩	-	-			-
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）			652,227	652,227	652,227
当期変動額合計	12,579,078	4,119,040	652,227	652,227	3,466,812
当期末残高	4,119,040	88,214,986	297,138	297,138	88,512,124

## [注記事項]

## (重要な会計方針)

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社株式

移動平均法による原価法

## (2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外

決算日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産（リース資産を除く）

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

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 4～15年

## (2) 無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

のれん 14年

顧客関連資産 6～19年

ソフトウェア（自社利用分） 5年（社内における利用可能期間）

## (3) リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

### 3. 引当金の計上基準

#### (1) 貸倒引当金

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

#### (2) 賞与引当金

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

#### (3) 退職給付引当金

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

##### 退職給付見込額の期間帰属方法

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

##### 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

### 4. 収益及び費用の計上基準

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

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

#### (1) 委託者報酬

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

#### (2) 運用受託報酬

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

#### (3) 投資助言報酬

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

#### (会計方針の変更)

「収益認識会計基準」等を当事業年度の期首から適用し、約束したサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該サービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。当該会計基準等の適用が当事業年度の財務諸表に与える影響はありません。なお、収益認識会計基準第89-3項に定める経過的な取扱いに従って、前事業年度に係る「収益認識関係」注記については記載していません。

#### (貸借対照表関係)

##### 1 有形固定資産の減価償却累計額

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

##### 2 当座借越契約

当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
当座借越極度額の総額	10,000,000千円	10,000,000千円
借入実行残高	- 千円	- 千円
差引額	10,000,000千円	10,000,000千円

## 3 保証債務

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

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
Sumitomo Mitsui DS Asset Management (USA) Inc.	93,374千円	57,356千円

## (損益計算書関係)

## 1 固定資産除却損

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

## 2 減損損失

前事業年度において、次のとおり減損損失を計上しております。

(単位：千円)

場所	用途	種類	減損損失
-	その他	のれん	28,097,346

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

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

なお、回収可能価額は使用価値としており、将来キャッシュ・フローを9.2%で割り引いて算出しております。当事業年度において計上した減損損失はありません。

## 3 システム統合関連費用

社内システム統合に伴うものであり、主にデータの移行費用などであります。

## 4 早期退職費用

早期希望退職の募集等の実施に関連して発生する費用であります。

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

## 1. 発行済株式数に関する事項

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

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## 配当金支払額等

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

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

## 1. 発行済株式数に関する事項

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数

普通株式	33,870,060株	-	-	33,870,060株
------	-------------	---	---	-------------

## 2. 剰余金の配当に関する事項

基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年6月28日 定時株主総会	普通株式	2,540,254	75.00	2022年 3月31日	2022年 6月29日

## (リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

(借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
1年以内	1,194,699	1,166,952
1年超	3,497,258	2,323,090
合計	4,691,958	3,490,042

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

投資有価証券については、主に事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等であり、市場価格の変動リスク及び発行体の信用リスクに晒されています。関係会社株式については、主に全額出資の子会社の株式であり、発行体の信用リスクに晒されています。

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 信用リスクの管理

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

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

## 市場リスクの管理

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のないものは、次表には含まれていません(注2)参照)。

前事業年度(2021年3月31日)

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
----	----------	----	----

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

当事業年度（2022年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	49,008,279	49,008,279	-
(2)顧客分別金信託	300,041	300,041	-
(3)未収委託者報酬	12,125,117	12,125,117	-
(4)未収運用受託報酬	2,437,063	2,437,063	-
(5)未収投資助言報酬	388,639	388,639	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	14,172,545	14,172,545	-
資産計	78,431,686	78,431,686	-
(1)顧客からの預り金	6,045	6,045	-
(2)未払手数料	5,545,582	5,545,582	-
負債計	5,551,627	5,551,627	-

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

(1)現金及び預金、(2)顧客分別金信託、(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬及び(5)未収投資助言報酬  
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

(6)投資有価証券

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

負 債

(1)顧客からの預り金及び(2)未払手数料

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

（注2）市場価格のない金融商品の貸借対照表計上額

（単位：千円）

区分	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
その他有価証券 非上場株式	39,809	39,809
合計	39,809	39,809
子会社株式 非上場株式	11,246,398	11,246,398
合計	11,246,398	11,246,398

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

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

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

（注3）金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2021年3月31日）

（単位：千円）

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
----	------	---------	----------	------



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

当事業年度（2022年3月31日）

（単位：千円）

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	49,008,279	-	-	-
顧客分別金信託	300,041	-	-	-
未収委託者報酬	12,125,117	-	-	-
未収運用受託報酬	2,437,063	-	-	-
未収投資助言報酬	388,639	-	-	-
合計	64,259,140	-	-	-

（有価証券関係）

1. 子会社株式

前事業年度（2021年3月31日）

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

当事業年度（2022年3月31日）

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

2. その他有価証券

前事業年度（2021年3月31日）

（単位：千円）

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

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

当事業年度（2022年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1) 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	9,299,062	8,672,725	626,337
小計	9,299,062	8,672,725	626,337
(2) 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	4,873,482	5,039,817	166,335
小計	4,873,482	5,039,817	166,335
合計	14,172,545	13,712,543	460,001

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

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：千円）

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

（単位：千円）

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

当事業年度(自 2021年 4月 1日 至 2022年 3月31日)

(単位：千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
4,082,976	911,268	81,384

(単位：千円)

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

## 4. 減損処理を行った有価証券

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

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

当事業年度において、減損処理を行った有価証券はありません。

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

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

## (2)退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 (2021年 3月31日)	当事業年度 (2022年 3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	5,258,448	5,084,506
未認識数理計算上の差異	-	-
未認識過去勤務費用	-	-
退職給付引当金	5,258,448	5,084,506

## (3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

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

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

## (4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表わしております。）

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

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度239,162千円、当事業年度237,296千円であります。

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	(単位：千円)	
	前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022年3月31日)
<b>繰延税金資産</b>		
退職給付引当金	1,610,136	1,556,876
賞与引当金	464,389	643,119
調査費	247,208	279,809
未払金	206,090	284,070
未払事業税	66,891	139,522
ソフトウェア償却	90,431	107,998
子会社株式評価損	114,876	114,876
その他有価証券評価差額金	131,391	93,946
その他	35,930	28,056
繰延税金資産小計	2,967,346	3,248,274
評価性引当額(注)	218,966	189,102
繰延税金資産合計	2,748,380	3,059,171
<b>繰延税金負債</b>		
無形固定資産	4,798,732	4,151,648
資産除去債務	-	825
その他有価証券評価差額金	516,605	186,107
繰延税金負債合計	5,315,338	4,338,581
繰延税金資産(負債)の純額	2,566,958	1,279,409

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

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

## (収益認識関係)

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

## (セグメント情報等)

前事業年度(自2020年4月1日至2021年3月31日)

## 1. セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業

活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

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

## 2. 関連情報

### (1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への 営業収益	50,610,457	9,450,169	1,270,584	233,628	61,564,839

### (2) 地域ごとの情報

#### 営業収益

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

#### 有形固定資産

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

### (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

## 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

## 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 2021年4月1日 至2022年3月31日)

### 1. セグメント情報

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

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

## 2. 関連情報

### (1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への 営業収益	66,139,024	9,652,634	1,256,334	231,982	77,279,976

### (2) 地域ごとの情報

#### 営業収益

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

#### 有形固定資産

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

### (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

## 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

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

## (関連当事者情報)

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (1)兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の子会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	3,728,851	未払 手数料	863,159
親会社の子会社	SMBC日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	5,578,226	未払 手数料	1,070,559

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

## 2. 親会社に関する注記

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

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (1)兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の子会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	4,727,024	未払 手数料	1,098,966
親会社の子会社	SMBC日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	8,397,864	未払 手数料	1,661,614

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

## 2. 親会社に関する注記

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

## (1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
1株当たり純資産額	2,510.93円	2,613.28円
1株当たり当期純利益又は 1株当たり当期純損失( )	854.27円	121.61円

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

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いません。	

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

- イ 定款の変更、その他の重要事項
  - (イ) 定款の変更  
該当ありません。
  - (ロ) その他の重要事項  
該当ありません。
- ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実  
該当ありません。

#### 第2【その他の関係法人の概況】

##### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

- イ 受託会社
  - (イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社
  - (ロ) 資本金の額 342,037百万円(2022年3月末現在)

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

〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

- ・ 名称 株式会社日本カストディ銀行
- ・ 資本金の額 51,000百万円（2022年3月末現在）
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

□ 販売会社

名称	資本金の額（百万円） 2022年3月末現在	事業の内容
株式会社三井住友銀行	1,770,996	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

□ 販売会社

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

3【資本関係】

（持株比率5%以上を記載しています。）  
該当ありません。

第3【その他】

1 目論見書の表紙から本文の前までおよび裏表紙の記載について

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

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

**独立監査人の監査報告書**

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5月2日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	菅野 雅子
--------------------	-------	-------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	松井 貴志
--------------------	-------	-------

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）の2022年2月19日から2023年2月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）の2023年2月20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5月2日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・年金バランス50（標準型）の2022年2月19日から2023年2月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・年金バランス50（標準型）の2023年2月20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5月2日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	菅野 雅子
--------------------	-------	-------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	松井 貴志
--------------------	-------	-------

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）の2022年2月19日から2023年2月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）の2023年2月20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。