

【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6月8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・DCつみたてNISA・世界分散ファンド
【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】	1兆円を上限とします。
【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・DCつみたてNISA・世界分散ファンド
以下「当ファンド」といいます。

(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】

1兆円を上限とします。

(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、「DC世界分散」として掲載されます。委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

(5)【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

(7) 【申込期間】

2023年6月9日から2023年12月7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。なお、委託会社においても申込みを取り扱う場合には、委託会社は販売会社としての役割も有します。

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

(9) 【払込期日】

取得申込者は、申込金額(取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数)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

(12) 【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 お申込不可日

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

- ・ニューヨークの取引所の休業日
- ・ロンドンの取引所の休業日
- ・ニューヨークの銀行の休業日

・ロンドンの銀行の休業日

ニ 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。

ホ 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、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資を行い、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。

ロ 委託会社は、受託会社と合意の上、金2,000億円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。

ハ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

（イ）当ファンドが該当する商品分類

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	内外	目論見書または信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 （収益の源泉）	資産複合	目論見書または信託約款において、株式、債券、不動産投信、その他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
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、不動産投信）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、債券および不動産投信であり、ファンドの収益はそれぞれの市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「資産複合」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル （日本を含む）	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。

為替ヘッジ	為替ヘッジあり (部分ヘッジ)	目論見書または信託約款において、一部の資産に 対円での為替のヘッジを行う旨の記載があるもの をいいます。
対象指数	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 める合成指数に連動する運用成果を目指す旨の記 載があるものをいいます。

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

(2) 【ファンドの沿革】

2017年10月 3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。

委託会社は販売会社としての役割も有する場合があります。

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

(ハ) 大株主の状況

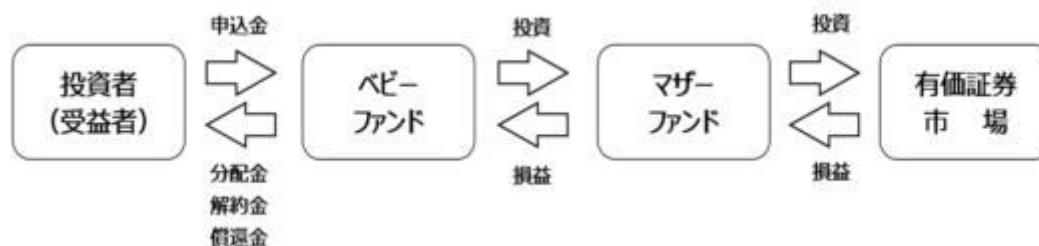
(2023年3月31日現在)

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

ハ ファンドの運用形態(ファミリーファンド方式による運用)

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



2【投資方針】

(1)【投資方針】

イ 基本方針

世界各国の債券、株式および不動産投資信託(リート)等に分散投資を行い、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て運用を行います。

ロ 投資態度

(イ) 以下の各指数の比率に基づいて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。

指数	比率
NOMURA - B P I (総合)	15%
F T S E 世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ換算ベース)	5%
F T S E 世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)	20%
T O P I X (東証株価指数、配当込み)	10%
M S C I コクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)	20%
M S C I エマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)	10%
東証 R E I T 指数(配当込み)	5%
S & P 先進国 R E I T 指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)	15%

(ロ) 以下のマザーファンド受益証券を主要投資対象とし、基本資産配分比率は下記の通りとします。

マザーファンドおよび対象指数	基本資産 配分比率
----------------	--------------

国内債券パッシブ・マザーファンド 対象指数：NOMURA - BPI (総合)	15%
ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド 対象指数：FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ換算ベース)	5%
外国債券パッシブ・マザーファンド 対象指数：FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)	20%
国内株式インデックス・マザーファンド(B号) 対象指数：TOPIX(東証株価指数、配当込み)	10%
外国株式インデックス・マザーファンド 対象指数：MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)	20%
エマージング株式インデックス・マザーファンド 対象指数：MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円換算ベース)	10%
Jリート・インデックス・マザーファンド 対象指数：東証REIT指数(配当込み)	5%
外国リート・インデックス・マザーファンド 対象指数：S&P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、円換算ベース)	15%

- (八) 実質組入外貨建資産については、マザーファンド受益証券で対円での為替ヘッジを行っている場合を除き、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (二) 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 マザーファンドへの投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資します。

債券 ■ 国内債券 ■ 先進国債券(除く日本、為替ヘッジあり) ■ 先進国債券(除く日本)

株式 ■ 国内株式 ■ 先進国株式(除く日本) ■ 新興国株式

リート ■ 国内リート ■ 外国リート

2 各マザーファンドが連動の対象とする指数を基本資産配分比率で組み合わせ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。

〔各マザーファンドの対象指数と基本資産配分比率〕

マザーファンド	対象指数	基本資産配分比率
国内債券パッシブ・マザーファンド	NOMURA-BPI(総合)	15%
ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ換算ベース)	5%
外国債券パッシブ・マザーファンド	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)	20%
国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	TOPIX(東証株価指数、配当込み)	10%
外国株式インデックス・マザーファンド	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)	20%
エマージング株式インデックス・マザーファンド	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)	10%
Jリート・インデックス・マザーファンド	東証REIT指数(配当込み)	5%
外国リート・インデックス・マザーファンド	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)	15%

3 実質組入外貨建資産については、マザーファンドで対円での為替ヘッジを行っている場合を除き、原則として為替ヘッジは行いません。

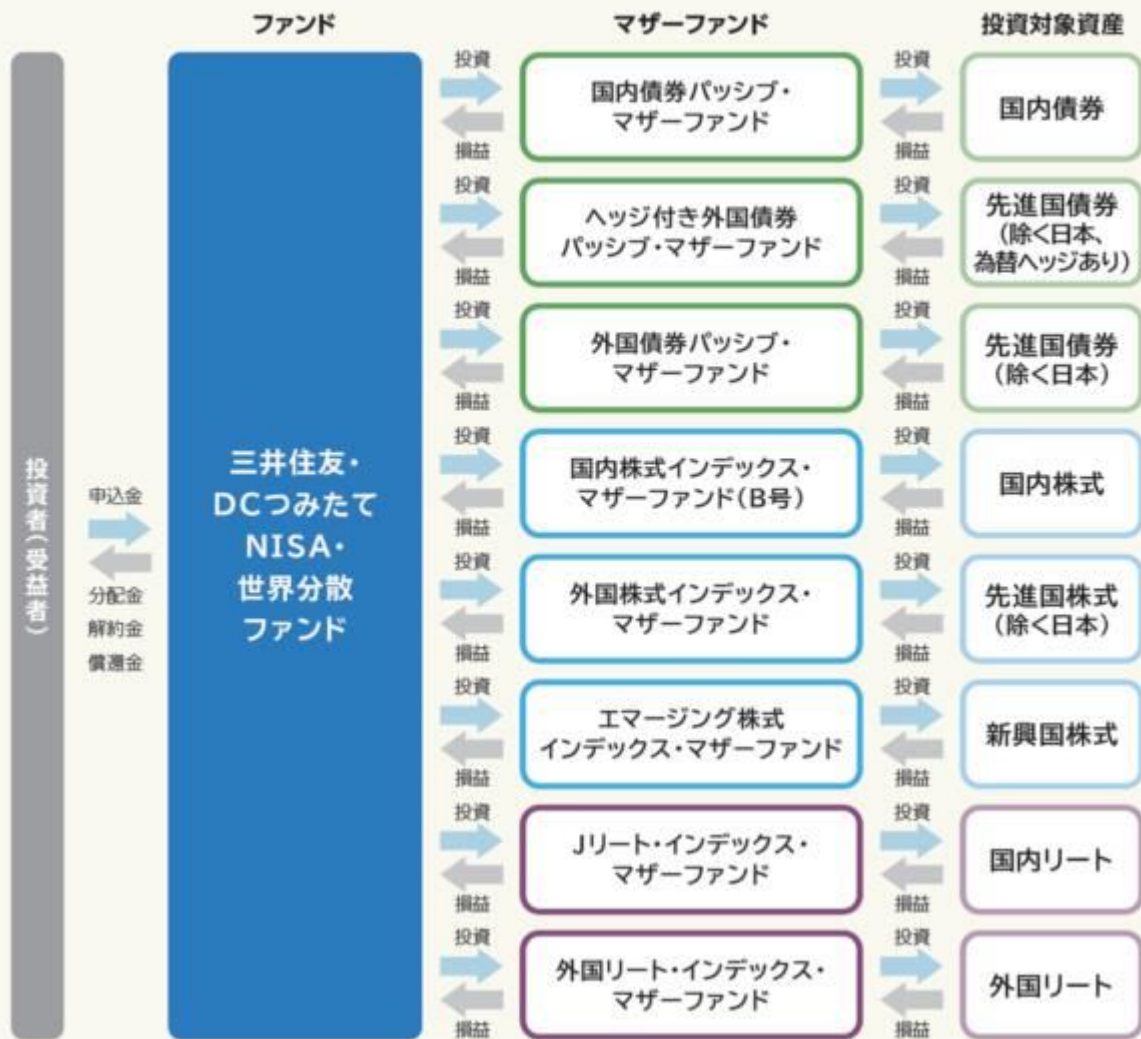
※資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

指数の著作権など

- 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、FTSE世界国債インデックスはFTSE Fixed Income LLC、TOPIX(東証株価指数)および東証REIT指数は株式会社JPX総研、MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスはMSCI Inc.、S&P先進国REIT指数はS&P Dow Jones Indices 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。

ファンドのしくみ

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



各マザーファンドの投資方針等

▶ 債券

国内債券

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

先進国債券(除く日本、為替ヘッジあり) …為替ヘッジあり

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

先進国債券(除く日本) …為替ヘッジなし

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

▶ 株式

国内株式

ファンド名	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	主としてTOPIX(東証株価指数)に採用されている銘柄の株式に投資を行い、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きと連動する投資成果を目指します。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.08%

先進国株式(除く日本)…為替ヘッジなし

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

新興国株式…為替ヘッジなし

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

▶リート

国内リート

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

外国リート…為替ヘッジなし

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

(2)【投資対象】

イ 投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

1. 有価証券
2. デリバティブ取引にかかる権利
3. 約束手形
4. 金銭債権

(ロ) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1. 為替手形

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として、国内債券パッシブ・マザーファンド、ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド、外国債券パッシブ・マザーファンド、国内株式インデックス・マザーファンド(B号)、外国株式インデックス・マザーファンド、エマージング株式インデックス・マザーファンド、Jリート・インデックス・マザーファンド、外国リート・インデックス・マザーファンド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. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
14. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
16. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限りません。)
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. 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。)
20. 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

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

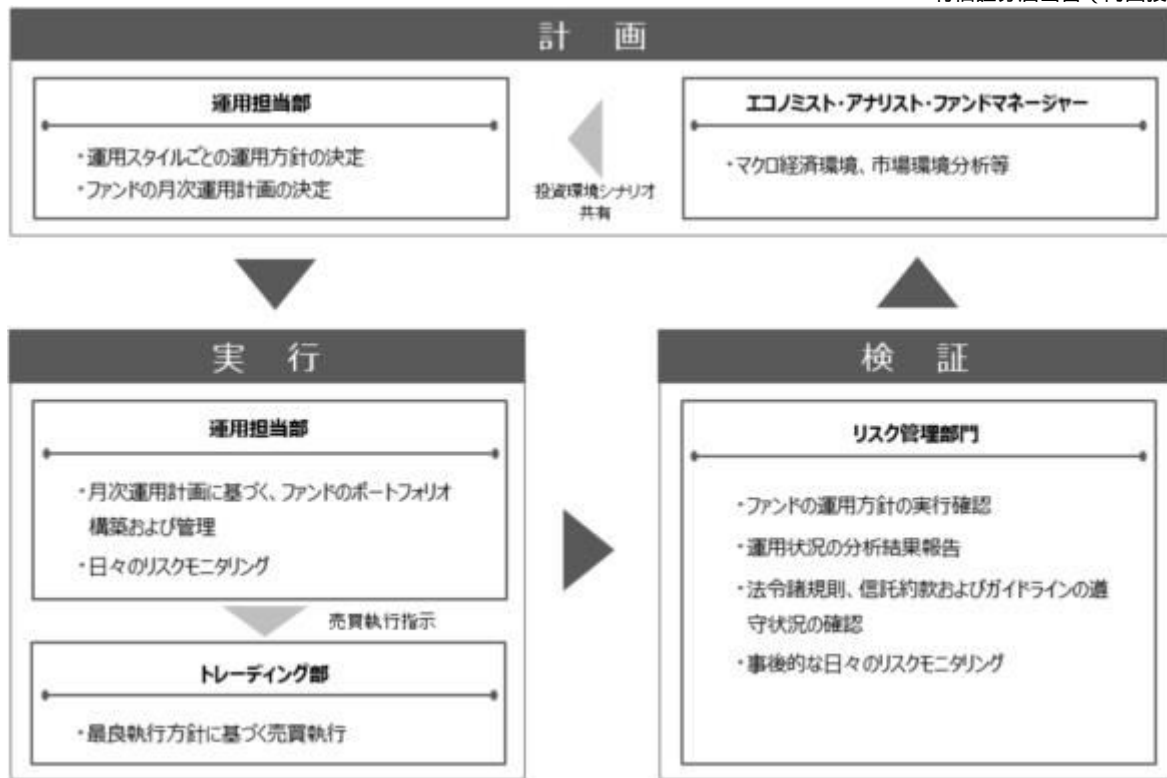
八 投資対象とする金融商品

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。

- 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9月10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。
- 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ハ 留保益の運用については特に制限を定めず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

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

（基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。）

（５）【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- イ 株式への実質投資割合には制限を設けません。

実質投資割合とは、当ファンドが保有するある種類の資産の評価額が当ファンドの純資産総額に占める比率（「組入比率」といいます。）と、当該同一種類の資産のマザーファンドに

おける組入比率に当該マザーファンド受益証券の当ファンドにおける組入比率を乗じて得た率を合計したものをいいます(以下同じ。)

- ロ 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
- ハ 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ニ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ホ デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、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。
- ヘ 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。

ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

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

ロ 投資する株式等の範囲

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

ハ 信用取引の指図

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

ニ 先物取引等の指図

- (イ) 委託会社は、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、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、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、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。

(ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

(ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

(ニ) 上記(ハ)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(ホ) スワップ取引の評価は、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、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行うものとします。

- (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。
- (二) 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、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。
- (二) 上記(ロ)において、信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ヲ 資金の借入れ
- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。
1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
 2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
 3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内
- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (二) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

法令に基づく投資制限

- イ 同一法人の発行する株式への投資制限(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)
委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数(株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。)が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。

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

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

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

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

(参考情報:マザーファンドの投資方針等)

(国内債券パッシブ・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 - B P I (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 - B P I (総合)をベンチマークとし、ベンチマークの動きと連動する投資成果を目指します。

(ロ) 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

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

(2)投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

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

八 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 八 投資対象とする金融商品」において記載した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(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。
- (二) 外貨建資産への投資は行いません。
- (ホ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- (ヘ) デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

(ヘッジ付き外国債券パッシブ・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、円ヘッジ換算ベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きと連動する投資成果を目指した運用を行います。

ロ 投資態度

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

- (ロ) ポートフォリオ構築にあたっては、取引コストを極力抑えながら、推定トラッキングエラーを最小化します。
- (ハ) ベンチマークの月次の変化状況とポートフォリオのリスク量の状況を勘案しながらリバランスを行います。
- (ニ) 保有する外貨建て資産については、対円での為替のフルヘッジを原則とします。
- (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

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

ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 八 投資対象とする金融商品」において記載した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) 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10%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割合には、制限を設けません。
- (ホ) 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。
- (ヘ) 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。
- (ト) 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。
- (チ) 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。
- (リ) 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と連動する投資成果を目指した運用を行います。

ロ 投資態度

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

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

1. 株券または新株引受権証書

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

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（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。

(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

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 特別の法律により法人の発行する債券
4. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
5. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
7. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

ハ 投資対象とする金融商品

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

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

します。

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

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

ハ 投資対象とする金融商品

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

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 株式への投資割合には制限を設けません。

(ロ) 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

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

(エマージング株式インデックス・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

M S C I エマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)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) 主として新興国の株式(預託証券(D R)、株式の値動きに連動する有価証券を含みます。)、新興国の株式指数を対象とした先物取引および新興国の株式等を主要投資対象とする上場投資信託証券に投資し、M S C I エマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)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) 運用にあたっては、ファンドの資産規模、市況動向に応じて株式、株価指数先物取引、上場投資信託証券、短期公社債等および為替取引を組み合わせ運用を行います。

(ハ) 外貨建資産について円に対する為替ヘッジは原則として行いません。

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

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)

6. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)

7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)

8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
 9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
 10. コマーシャル・ペーパー
 11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
 12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
 13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
 14. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
 15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 16. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
 17. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
 18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 19. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
 20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 21. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- 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アンドが投資対象とする金融商品に同じです。

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

(Jリート・インデックス・マザーファンド)

（１）投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

（２）投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

ハ 投資対象とする金融商品

前記「２ 投資方針（２）投資対象 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）投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- （ロ）株式への投資は行いません。
- （ハ）外貨建資産への投資は行いません。
- （ニ）一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- （ホ）デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます。）は、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

(外国リート・インデックス・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

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

(ハ) 不動産投資信託(REIT)の組入比率は、原則として高位を保ちます。

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

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

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載したベビーフンドが投資対象とする金融商品の各号のうち、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) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

(ロ) 株式への投資は行いません。

(ハ) 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

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）不動産投資信託（リート）に関するリスク

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

（ニ）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。

（ホ）為替変動リスク

ファンドは外貨建資産の一部について、原則として対円での為替ヘッジを行います。

為替ヘッジが行われていない部分については為替変動の影響を受けます。ファンドが保有する外貨建資産の価格が現地通貨ベースで上昇する場合であっても、当該現地通貨が対円で下落する（円高となる）場合、円ベースでの評価額が下落し、基準価額が下落することがあります。

為替ヘッジが行われている部分については為替変動の影響を受けますが、原則として対円での為替ヘッジを行うため、その影響は限定的と考えられます。ただし、完全に為替変動リスクを回避することはできません。なお、円金利がヘッジ対象通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当分のヘッジコストがかかることにご留意ください。また、需給要因等によっては金利差相当分以上にヘッジコストがかかる場合があります。

（ヘ）カントリーリスク

海外に投資を行う場合には、投資先の国の政治・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。

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

（ト）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。

□ 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。

- ・ マザーファンドの購入・換金に伴う信託財産留保額、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入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。
- ・ 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、換金申込みの受け付けが中止となる可能性、既に受け付けた換金申込みが取り消しとなる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性等があります。

（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。



※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JPMリサーチまたは株式会社JPMリサーチの関連会社が算出、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	JPMオルガン・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0.231%(税抜き0.21%)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0.09%	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0.10%	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。

委託会社が販売会社として募集の取扱い等をした部分については、販売会社配分相当額も委託会社が収受します。

(4) 【その他の手数料等】

- イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、原則として、計算期間を通じて毎日、純資産総額に年0.0066%(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、マザーファンドの購入・換金に伴う信託財産留保額等(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な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ついては、各販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本の算出が行われることがあります。
- (ハ) 受益者が元本払戻金(特別分配金)を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。(「元本払戻金(特別分配金)」については、下記の(収益分配金の課税について)を参照。)

ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

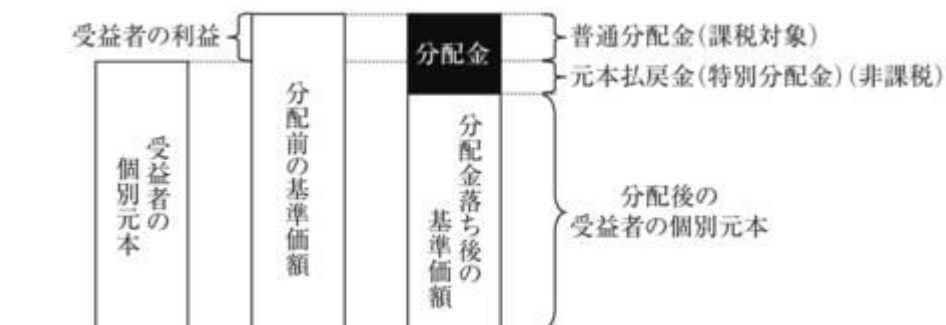
ハ 収益分配金の課税について

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

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



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



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

二 個人、法人別の課税の取扱いについて

(イ) 個人の受益者に対する課税

・ 収益分配時

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

・ 一部解約時および償還時

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

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

（ロ）法人の受益者に対する課税

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

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

なお、当ファンドは、配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

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

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。また、当ファンドは、非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度「つみたて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およびつみたてNISAでの取扱い対象としない場合があります。

※つみたてNISA、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。

	非課税累積投資契約に係る 少額投資非課税制度 つみたてNISA	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	一定の要件を満たした 公募株式投資信託 (新たに積立投資が必要)	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20年間 (新規の購入は2042年まで)	最長5年間 (新規の購入は2023年まで)*	
利用できる 限度額	40万円/年 (最大800万円)	120万円/年 (最大600万円)	80万円/年 (最大400万円)
留意事項	つみたてNISA ↔ NISA 同一年において、つみたてNISAとNISAを併用した投資を行うことはできません。		

*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・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

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 (%)
親投資信託受益証券	日本	1,835,862,304	99.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	18,029,784	0.97
合計(純資産総額)		1,853,892,088	100.00

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

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

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	外国債券パッシブ・マザーファンド	190,568,402	2.0400	388,766,354	1.9703	375,476,922	20.25
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	60,342,839	6.2911	379,623,107	6.1473	370,945,534	20.01
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	226,824,258	1.2399	281,250,663	1.2401	281,284,762	15.17
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	98,858,522	3.0199	298,541,230	2.6449	261,470,904	14.10
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド（B号）	53,921,029	3.3608	181,216,995	3.4858	187,957,922	10.14
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	109,129,383	1.7048	186,047,640	1.6467	179,703,354	9.69
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	71,784,094	1.2935	92,853,679	1.2619	90,584,348	4.89
日本	親投資信託受益証券	リート・インデックス・マザーファンド	35,524,627	2.7332	97,096,505	2.4895	88,438,558	4.77

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2023年3月31日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	99.03
合計	99.03

【投資不動産物件】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

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・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2018年 9月10日)	115,063,603	115,063,603	10,051	10,051
第2期 (2019年 9月10日)	295,583,344	295,583,344	10,442	10,442
第3期 (2020年 9月10日)	544,780,618	544,780,618	10,720	10,720
第4期 (2021年 9月10日)	1,014,406,357	1,014,406,357	12,869	12,869
第5期 (2022年 9月12日)	1,634,445,391	1,634,445,391	13,461	13,461
2022年 3月末日	1,336,995,790	-	13,355	-
4月末日	1,345,546,363	-	13,169	-
5月末日	1,375,771,901	-	13,029	-
6月末日	1,420,849,679	-	12,940	-
7月末日	1,495,859,284	-	13,224	-
8月末日	1,592,792,451	-	13,192	-
9月末日	1,556,761,045	-	12,584	-
10月末日	1,665,053,964	-	13,115	-
11月末日	1,691,666,097	-	13,016	-
12月末日	1,660,856,865	-	12,438	-
2023年 1月末日	1,762,639,507	-	12,803	-
2月末日	1,815,355,589	-	12,934	-
3月末日	1,853,892,088	-	12,865	-

【分配の推移】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2017年10月 3日～2018年 9月10日	0
第2期	2018年 9月11日～2019年 9月10日	0
第3期	2019年 9月11日～2020年 9月10日	0
第4期	2020年 9月11日～2021年 9月10日	0
第5期	2021年 9月11日～2022年 9月12日	0

【収益率の推移】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

	収益率(%)
第1期	0.5
第2期	3.9
第3期	2.7

第4期	20.0
第5期	4.6
第6期(中間期)	4.6

(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・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	134,068,987	19,587,428
第2期	198,345,231	29,755,343
第3期	284,669,114	59,535,952
第4期	357,578,274	77,546,767
第5期	503,710,231	77,728,393
第6期(中間期)	252,591,718	54,854,259

(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

ヘッジ付き外国債券パッシブ・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	12,157,360,215	49.01
	フランス	2,083,991,177	8.40
	イタリア	1,886,808,556	7.61
	ドイツ	1,607,889,183	6.48
	スペイン	1,246,995,067	5.03
	イギリス	1,190,842,815	4.80

中国	1,141,472,814	4.60	
カナダ	503,166,316	2.03	
ベルギー	465,053,401	1.87	
オーストラリア	391,115,506	1.58	
オランダ	385,474,893	1.55	
オーストリア	297,611,781	1.20	
シンガポール	244,067,329	0.98	
メキシコ	213,279,753	0.86	
アイルランド	149,363,276	0.60	
フィンランド	126,180,332	0.51	
ポーランド	115,607,267	0.47	
イスラエル	80,933,970	0.33	
デンマーク	79,380,269	0.32	
ニュージーランド	54,797,202	0.22	
スウェーデン	51,490,214	0.21	
ノルウェー	46,195,997	0.19	
小計	24,519,077,333	98.84	
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	287,275,658	1.16
合計（純資産総額）		24,806,352,991	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建	-	133,161,002	0.54
為替予約取引	売建	-	24,276,127,319	97.86

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

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

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

エマージング株式インデックス・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	ケイマン諸島	5,177,935,828	17.22
	台湾	4,092,459,245	13.61
	インド	3,560,716,679	11.84

	韓国	3,270,540,798	10.88
	中国	1,957,006,799	6.51
	ブラジル	1,317,669,915	4.38
	南アフリカ	948,184,390	3.15
	タイ	588,344,359	1.96
	メキシコ	573,776,041	1.91
	インドネシア	524,972,044	1.75
	マレーシア	401,037,507	1.33
	香港	316,641,320	1.05
	フィリピン	199,273,848	0.66
	ポーランド	177,093,669	0.59
	トルコ	171,532,260	0.57
	チリ	153,627,678	0.51
	アメリカ	139,544,065	0.46
	バミューダ	135,361,005	0.45
	ギリシャ	104,950,637	0.35
	ハンガリー	51,217,573	0.17
	チェコ	48,230,528	0.16
	コロンビア	22,368,825	0.07
	ルクセンブルグ	20,562,338	0.07
	エジプト	18,497,186	0.06
	オランダ	17,693,590	0.06
	ペルー	6,567,851	0.02
	シンガポール	6,334,609	0.02
	小計	24,002,140,587	79.81
投資信託受益証券	香港	1,453,933,686	4.83
投資証券	アメリカ	1,946,878,412	6.47
	メキシコ	160,563,065	0.53
	ブラジル	42,853,395	0.14
	南アフリカ	9,314,219	0.03
	小計	2,159,609,091	7.18
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	2,457,681,400	8.18
合計(純資産総額)		30,073,364,764	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	2,511,754,714	8.35
合計	買建	-	2,511,754,714	8.35

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	-	28,489,047	0.09

Jリート・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 (%)

投資証券	日本	10,738,342,650	98.22
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	194,339,339	1.78
合計（純資産総額）		10,932,681,989	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率 （％）
リート指数先物取引	買建	日本	35,540,000	0.33
合計	買建	-	35,540,000	0.33

外国リート・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 （％）
投資証券	アメリカ	19,259,740,251	75.78
	オーストラリア	1,650,843,825	6.50
	イギリス	1,205,128,160	4.74
	シンガポール	963,146,627	3.79
	フランス	451,010,601	1.77
	カナダ	449,981,963	1.77
	香港	399,033,507	1.57
	ベルギー	287,761,004	1.13
	スペイン	105,497,690	0.42
	ニュージーランド	103,040,182	0.41
	韓国	57,500,468	0.23
	オランダ	51,367,474	0.20
	ガーンジー	34,943,582	0.14
	イスラエル	31,819,621	0.13
	ドイツ	12,398,615	0.05
	アイルランド	8,573,103	0.03
イタリア	3,282,064	0.01	
小計		25,075,068,737	98.66
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	339,414,165	1.34
合計（純資産総額）		25,414,482,902	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率 （％）
為替予約取引	買建	-	45,387,217	0.18

（２）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

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	3,050,000,000	99.94	3,048,170,000	100.18	3,055,581,500	0.005	2025/01/01	2.52
		年国債								
日本	国債証券	3 6 3 1	1,610,000,000	98.77	1,590,263,900	98.20	1,581,003,900	0.100	2031/06/20	1.30
		0年国債								
日本	国債証券	1 4 7 5	1,310,000,000	100.17	1,312,227,000	100.18	1,312,318,700	0.005	2026/03/20	1.08
		年国債								
日本	国債証券	1 5 6 5	1,270,000,000	99.94	1,269,238,000	100.54	1,276,858,000	0.200	2027/12/20	1.05
		年国債								
日本	国債証券	1 4 9 5	1,240,000,000	100.15	1,241,872,400	100.10	1,241,289,600	0.005	2026/09/20	1.02
		年国債								
日本	国債証券	1 5 0 5	1,230,000,000	100.13	1,231,642,400	100.02	1,230,221,400	0.005	2026/12/20	1.01
		年国債								
日本	国債証券	1 4 5 5	1,180,000,000	100.49	1,185,778,800	100.43	1,185,097,600	0.100	2025/09/20	0.98
		年国債								
日本	国債証券	1 5 3 5	1,140,000,000	99.19	1,130,740,500	99.85	1,138,312,800	0.005	2027/06/20	0.94
		年国債								
日本	国債証券	1 4 8 5	1,130,000,000	100.15	1,131,695,000	100.16	1,131,808,000	0.005	2026/06/20	0.93
		年国債								
日本	国債証券	3 6 2 1	1,150,000,000	99.22	1,140,979,000	98.41	1,131,669,000	0.100	2031/03/20	0.93
		0年国債								
日本	国債証券	3 6 9 1	1,110,000,000	100.00	1,110,022,200	101.70	1,128,814,500	0.500	2032/12/20	0.93
		0年国債								
日本	国債証券	1 5 4 5	1,020,000,000	99.87	1,018,674,000	100.18	1,021,815,600	0.100	2027/09/20	0.84
		年国債								
日本	国債証券	1 4 6 5	1,000,000,000	100.52	1,005,167,200	100.45	1,004,480,000	0.100	2025/12/20	0.83
		年国債								
日本	国債証券	3 5 9 1	1,000,000,000	99.51	995,133,000	99.08	990,770,000	0.100	2030/06/20	0.82
		0年国債								
日本	国債証券	1 4 4 5	980,000,000	100.48	984,664,800	100.40	983,910,200	0.100	2025/06/20	0.81
		年国債								
日本	国債証券	3 6 1 1	980,000,000	98.50	965,311,400	98.64	966,672,000	0.100	2030/12/20	0.80
		0年国債								
日本	国債証券	3 5 8 1	940,000,000	99.68	936,965,600	99.25	932,903,000	0.100	2030/03/20	0.77
		0年国債								
日本	国債証券	3 6 0 1	910,000,000	99.55	905,915,600	98.90	899,990,000	0.100	2030/09/20	0.74
		0年国債								
日本	国債証券	1 5 1 2	840,000,000	107.51	903,109,100	107.04	899,102,400	1.200	2034/12/20	0.74
		0年国債								
日本	国債証券	3 6 5 1	890,000,000	99.06	881,634,000	98.05	872,653,900	0.100	2031/12/20	0.72
		0年国債								
日本	国債証券	3 5 6 1	850,000,000	98.57	837,870,400	99.49	845,648,000	0.100	2029/09/20	0.70
		0年国債								
日本	国債証券	3 6 7 1	840,000,000	99.87	838,908,000	99.59	836,589,600	0.200	2032/06/20	0.69
		0年国債								
日本	国債証券	3 4 4 1	811,000,000	100.56	815,557,820	100.43	814,511,630	0.100	2026/09/20	0.67
		0年国債								
日本	国債証券	3 3 8 1	805,000,000	101.30	815,440,850	100.96	812,744,100	0.400	2025/03/20	0.67
		0年国債								
日本	国債証券	8 8 2 0	742,000,000	109.51	812,586,460	107.56	798,124,880	2.300	2026/06/20	0.66
		年国債								
日本	国債証券	3 3 9 1	785,000,000	101.40	795,974,300	101.06	793,352,400	0.400	2025/06/20	0.65
		0年国債								

日本	国債証券	3 4 0 1 0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 1 0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 1 0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

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

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	3,200,000	13,330.05	426,561,585	13,332.84	426,650,783	4.125	2025/01/31	1.72
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,700,000	13,202.26	224,438,371	13,237.63	225,039,711	3.500	2028/01/31	0.91
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,680,000	13,012.39	218,608,168	12,957.08	217,679,003	3.125	2028/11/15	0.88
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	13,133.33	210,133,223	13,108.77	209,740,378	3.000	2024/06/30	0.85
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	8,700,000	1,977.76	172,065,318	1,958.69	170,405,688	2.910	2028/10/14	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,270,000	13,303.87	168,959,138	13,377.70	169,896,828	4.000	2025/12/15	0.68
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,230,000	13,066.69	160,720,290	13,061.10	160,651,572	2.500	2024/04/30	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,160,000	12,607.23	146,243,869	12,729.68	147,664,310	0.250	2024/05/15	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,200,000	12,091.89	145,102,644	12,143.08	145,717,016	0.375	2025/12/31	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,030,000	12,753.62	131,362,244	12,779.76	131,631,483	0.375	2024/04/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	13,215.82	132,158,187	13,066.04	130,660,440	3.625	2053/02/15	0.53
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	6,500,000	1,943.85	126,350,454	1,929.56	125,421,535	2.480	2027/04/15	0.51

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,140,000	11,059.18	126,074,630	10,881.09	124,044,456	0.625	2030/05/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	890,000	13,212.99	117,595,594	13,299.72	118,367,521	3.500	2033/02/15	0.48
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000	1,950.02	117,001,048	1,942.40	116,543,763	2.280	2024/03/17	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	890,000	12,999.56	115,696,060	12,986.46	115,579,495	2.750	2025/05/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	910,000	13,084.34	119,067,472	12,638.88	115,013,822	2.875	2032/05/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	920,000	12,343.52	113,560,376	12,437.25	114,422,711	0.500	2025/03/31	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,030,000	10,951.37	112,799,066	10,829.68	111,545,740	0.625	2030/08/15	0.45
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	5,600,000	1,984.79	111,147,987	1,969.64	110,299,655	3.020	2031/05/27	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	930,000	11,873.62	110,424,676	11,547.94	107,395,855	1.625	2031/05/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	810,000	13,051.51	105,717,265	13,102.76	106,132,394	3.000	2024/07/31	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	830,000	12,659.26	105,071,819	12,691.76	105,341,603	1.375	2025/01/31	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	920,000	11,434.44	105,196,856	11,140.27	102,490,524	1.250	2031/08/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	730,000	13,883.12	101,346,799	13,955.89	101,877,982	4.125	2032/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	850,000	12,005.15	102,043,759	11,658.77	99,099,556	1.875	2032/02/15	0.40
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	4,700,000	2,134.78	100,334,605	2,108.25	99,087,633	3.720	2051/04/12	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	700,000	13,632.06	95,424,398	13,586.68	95,106,742	4.000	2042/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	760,000	12,416.89	94,368,395	12,496.41	94,972,678	2.750	2032/08/15	0.38
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	4,800,000	1,930.37	92,657,875	1,930.14	92,646,938	2.280	2025/11/25	0.37

□ 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	98.84
合計	98.84

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

口 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

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(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

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-CLASS 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-CLASS 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-CLASS 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

エマージング株式インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

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 (%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・ 半導体製 造装置	778,000	2,143.93	1,667,980,223	2,342.77	1,822,671,170	6.06
香港	投資信 託受益 証券	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	-	1,811,400	774.0248	1,402,068,588	802.6574	1,453,933,686	4.83
ケイマン 諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディ ア・娯楽	196,800	4,754.25	935,637,110	6,548.85	1,288,813,680	4.29
アメリカ	投資証 券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	-	211,519	5,194.18	1,098,667,288	5,162.27	1,091,918,145	3.63
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノ ロジー・ ハード ウェアお よび機器	150,942	6,268.76	946,218,651	6,515.92	983,525,996	3.27
ケイマン 諸島	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	468,600	1,357.65	636,196,250	1,648.27	772,378,853	2.57
ケイマン 諸島	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者 サービス	158,760	2,607.84	414,020,824	2,415.42	383,472,079	1.28
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネル ギー	96,432	4,382.94	422,655,828	3,664.91	353,414,408	1.18
アメリカ	投資証 券	ISHARES MSCI UAE ETF	-	187,537	2,043.88	383,303,644	1,880.10	352,588,763	1.17
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	3,051,000	80.49	245,569,341	86.24	263,120,375	0.87
ブラジル	株式	VALE SA	素材	120,688	2,218.08	267,695,269	2,142.71	258,599,425	0.86
アメリカ	投資証 券	ISHARES MSCI QATAR ETF	-	105,715	2,690.89	284,467,376	2,415.56	255,360,682	0.85

アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI KUWAIT ETF	-	57,574	4,669.40	268,836,071	4,290.32	247,010,820	0.82
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	106,790	2,649.69	282,960,879	2,269.02	242,308,859	0.81
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	金融サービス	54,870	4,366.07	239,566,217	4,269.00	234,240,139	0.78
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	163,823	1,535.32	251,520,776	1,395.64	228,637,931	0.76
ケイマン諸島	株式	JD.COM INC - CLASS A	一般消費財・サービス流通・小売り	68,685	3,522.90	241,970,201	2,776.03	190,671,757	0.63
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	393,800	438.39	172,637,039	457.61	180,205,045	0.60
ケイマン諸島	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・娯楽	70,200	1,754.33	123,153,719	2,543.00	178,518,249	0.59
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	200,000	817.24	163,448,771	864.11	172,821,600	0.57
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	一般消費財・サービス流通・小売り	6,874	19,387.73	133,271,228	24,848.52	170,808,756	0.57
ケイマン諸島	株式	PDD HOLDINGS INC	一般消費財・サービス流通・小売り	16,082	10,671.73	171,622,693	10,207.03	164,149,507	0.55
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	48,000	3,146.53	151,033,588	3,406.86	163,529,376	0.54
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	17,232	8,717.03	150,211,853	9,155.28	157,763,784	0.52
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	28,870	5,569.68	160,796,644	5,147.80	148,616,870	0.49
ケイマン諸島	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	62,200	1,887.92	117,428,804	2,311.66	143,785,189	0.48
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	25,970	5,664.16	147,098,328	5,505.54	142,978,873	0.48
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	1,768,300	80.00	141,470,602	78.54	138,886,702	0.46

中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	1,801,000	66.18	119,193,181	72.63	130,811,492	0.43
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	2,534,000	47.26	119,746,330	51.37	130,172,086	0.43

□ 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	3.80
	素材	6.39
	資本財	2.83
	商業・専門サービス	0.06
	運輸	1.72
	自動車・自動車部品	2.83
	耐久消費財・アパレル	1.38
	消費者サービス	2.63
	一般消費財・サービス流通・小売り	5.29
	生活必需品流通・小売り	1.42
	食品・飲料・タバコ	2.60
	家庭用品・パーソナル用品	0.77
	ヘルスケア機器・サービス	0.67
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.20
	銀行	10.17
	金融サービス	2.53
	保険	2.29
	ソフトウェア・サービス	2.03
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.45
	半導体・半導体製造装置	8.47
電気通信サービス	2.08	
公益事業	2.09	
メディア・娯楽	6.80	
不動産管理・開発	1.32	
投資信託受益証券	-	4.83
投資証券	-	7.18
合計		91.83

Jリート・インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

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	投資証券	日本ビルファンド 投資法人	1,249	573,807.59	716,685,683	551,000.00	688,199,000	6.29
日本	投資証券	ジャパンリアルエ ステイト投資法人	1,071	570,735.16	611,257,356	528,000.00	565,488,000	5.17

日本	投資証券	日本都市ファンド 投資法人	5,403	101,760.98	549,814,579	96,700.00	522,470,100	4.78
日本	投資証券	野村不動産マス ターファンド投資 法人	3,461	150,670.86	521,471,856	148,500.00	513,958,500	4.70
日本	投資証券	日本プロロジス リート投資法人	1,805	294,401.51	531,394,732	280,300.00	505,941,500	4.63
日本	投資証券	G L P 投資法人	3,456	144,312.83	498,745,139	143,100.00	494,553,600	4.52
日本	投資証券	大和ハウスリート 投資法人	1,614	277,936.17	448,588,986	271,500.00	438,201,000	4.01
日本	投資証券	オリックス不動産 投資法人	2,134	182,872.62	390,250,177	168,000.00	358,512,000	3.28
日本	投資証券	ユナイテッド・ アーバン投資法人	2,396	151,896.49	363,943,983	143,000.00	342,628,000	3.13
日本	投資証券	アドバンス・レジ デンス投資法人	1,070	333,813.40	357,180,343	316,500.00	338,655,000	3.10
日本	投資証券	インヴィンシブル 投資法人	4,718	55,369.74	261,234,456	55,700.00	262,792,600	2.40
日本	投資証券	ジャパン・ホテ ル・リート投資法 人	3,455	77,254.92	266,915,751	75,100.00	259,470,500	2.37
日本	投資証券	日本プライムリア ルティ投資法人	732	360,348.95	263,775,429	349,000.00	255,468,000	2.34
日本	投資証券	産業ファンド投資 法人	1,633	143,891.79	234,975,289	144,200.00	235,478,600	2.15
日本	投資証券	積水ハウス・リ ート投資法人	3,221	72,077.91	232,162,944	71,900.00	231,589,900	2.12
日本	投資証券	日本アコモデー ションファンド投 資法人	371	609,620.60	226,169,241	597,000.00	221,487,000	2.03
日本	投資証券	アクティブア・ブ ロパティーズ投資 法人	566	391,769.64	221,741,614	378,000.00	213,948,000	1.96
日本	投資証券	日本ロジスティク スファンド投資法 人	723	296,363.00	214,270,446	294,500.00	212,923,500	1.95
日本	投資証券	ラサールロジポ ート投資法人	1,313	156,279.59	205,195,101	153,700.00	201,808,100	1.85
日本	投資証券	三井不動産ロジ スティクスパーク 投資法人	422	453,509.78	191,381,126	465,000.00	196,230,000	1.79
日本	投資証券	ケネディクス・ オフィス投資法人	624	318,876.43	198,978,890	306,500.00	191,256,000	1.75
日本	投資証券	フロンティア不 動産投資法人	397	506,693.46	201,157,303	475,000.00	188,575,000	1.72
日本	投資証券	森ヒルズリート 投資法人	1,260	152,945.22	192,710,974	147,600.00	185,976,000	1.70
日本	投資証券	イオンリート投 資法人	1,227	148,638.89	182,379,919	144,900.00	177,792,300	1.63
日本	投資証券	大和証券リビ ング投資法人	1,491	113,600.00	169,377,600	108,900.00	162,369,900	1.49

日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	511	311,969.55	159,416,440	315,500.00	161,220,500	1.47
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	785	205,845.33	161,588,585	204,800.00	160,768,000	1.47
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	1,003	151,960.76	152,416,639	149,600.00	150,048,800	1.37
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	368	404,429.26	148,829,969	390,500.00	143,704,000	1.31
日本	投資証券	N T T都市開発リート投資法人	1,031	135,551.26	139,753,352	134,900.00	139,081,900	1.27

□ 種類別投資比率

2023年3月31日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	98.22
合計	98.22

外国リート・インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

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(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	140,210	16,200.05	2,271,409,304	16,279.98	2,282,615,659	8.98
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	14,106	91,448.84	1,289,977,370	93,739.40	1,322,287,910	5.20
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	24,132	39,138.85	944,498,763	39,343.28	949,432,013	3.74
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	95,836	8,665.98	830,513,250	8,360.31	801,218,985	3.15
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	50,002	16,222.11	811,138,098	14,362.49	718,153,064	2.83
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	71,756	9,986.43	716,586,028	9,473.95	679,813,007	2.67
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	151,591	4,434.05	672,161,656	4,247.59	643,896,309	2.53
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	43,842	13,994.76	613,558,333	12,481.05	547,194,154	2.15
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,476	23,306.08	500,521,397	21,800.11	468,179,115	1.84
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	261,832	1,788.09	468,178,596	1,673.62	438,206,067	1.72
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	20,140	21,470.29	432,411,614	21,208.57	427,140,597	1.68
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	51,672	8,484.57	438,414,776	7,815.51	403,843,079	1.59
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	23,830	20,057.62	477,973,172	16,555.05	394,506,827	1.55
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	89,111	4,203.63	374,589,569	4,099.37	365,299,049	1.44
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	60,416	6,635.11	400,866,545	5,936.74	358,674,313	1.41

アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	17,791	21,779.59	387,480,654	19,826.53	352,733,873	1.39
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	18,735	19,568.82	366,621,870	18,610.08	348,659,775	1.37
香港	投資証券	LINK REIT	388,700	852.48	331,360,273	857.30	333,234,064	1.31
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	31,640	10,942.26	346,213,112	10,295.16	325,738,957	1.28
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	43,700	6,983.62	305,184,150	6,915.52	302,208,167	1.19
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,829	30,639.79	301,158,533	27,264.16	267,979,383	1.05
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	39,106	7,038.03	275,229,039	6,798.01	265,843,069	1.05
アメリカ	投資証券	UDR INC	46,541	5,825.91	271,143,858	5,325.18	247,839,034	0.98
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	82,819	3,263.36	270,267,963	2,896.27	239,865,829	0.94
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	27,136	9,228.84	250,433,727	8,775.59	238,134,453	0.94
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	93,700	2,756.06	258,242,747	2,511.70	235,346,224	0.93
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	16,854	15,459.73	260,558,253	13,781.63	232,275,613	0.91
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	108,783	2,267.34	246,647,981	2,108.44	229,362,287	0.90
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	179,959	1,367.19	246,038,951	1,259.91	226,732,431	0.89
アメリカ	投資証券	REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	28,980	8,031.52	232,753,472	7,755.42	224,752,141	0.88

□ 種類別投資比率

2023年3月31日現在

種類	投資比率 (%)
投資証券	98.66
合計	98.66

投資不動産物件

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。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

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。

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

Jリート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

外国リート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

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	ユーロ	買建	440,000.00	63,351,398	64,087,716	0.26
	アメリカ・ドル	買建	370,000.00	49,546,614	49,370,432	0.20
	イギリス・ポンド	買建	30,000.00	4,888,413	4,963,638	0.02
	カナダ・ドル	買建	50,000.00	4,895,555	4,934,285	0.02
	オーストラリア・ドル	買建	50,000.00	4,500,061	4,482,180	0.02
	シンガポール・ドル	買建	40,000.00	3,987,944	4,021,500	0.02
	ニュージーランド・ドル	買建	10,000.00	842,747	836,529	0.00
	デンマーク・クローネ	買建	20,000.00	387,116	391,058	0.00
	メキシコ・ペソ	買建	10,000.00	73,786	73,664	0.00
	アメリカ・ドル	売建	89,790,000.00	12,125,898,951	11,981,002,944	48.30
	ユーロ	売建	56,430,000.00	8,106,269,497	8,219,249,577	33.13
	イギリス・ポンド	売建	7,030,000.00	1,150,799,750	1,163,145,838	4.69
	オフショア・人民元	売建	59,350,000.00	1,156,024,028	1,151,769,840	4.64
	カナダ・ドル	売建	5,040,000.00	499,461,584	497,375,928	2.01
	オーストラリア・ドル	売建	4,290,000.00	390,481,391	384,571,044	1.55
	シンガポール・ドル	売建	2,400,000.00	240,934,537	241,290,000	0.97
	メキシコ・ペソ	売建	29,060,000.00	212,487,813	214,067,584	0.86
	ポーランド・ズロチ	売建	3,690,000.00	112,216,949	114,853,464	0.46
	イスラエル・シェケル	売建	2,180,000.00	80,550,524	80,813,036	0.33
	デンマーク・クローネ	売建	4,000,000.00	77,233,334	78,211,600	0.32
ニュージーランド・ドル	売建	640,000.00	53,558,106	53,537,856	0.22	
スウェーデン・クローナ	売建	3,930,000.00	50,933,609	50,675,778	0.20	
ノルウェー・クローネ	売建	3,550,000.00	46,411,635	45,562,830	0.18	

(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。

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。

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	ICE EUEX	FTSE 100 INDEX 23 JUN 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	EUREX	EURO STOXX 50 JUN 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 EM INDEX JUN 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 FUTURE JUN 23 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。

エマージング株式インデックス・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	アメ リカ	IC E - US	M S C I E M G M K T J U N 2 3 2 0 2 3 年6月	買建	377	アメ リカ・ド ル	18,067,687.00	2,412,578,245	18,810,415.00	2,511,754,714	8.35

(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	213,445.71	28,000,000	28,489,047	0.09

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

Jリート・インデックス・マザーファンド

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 (%)
リート指 数先物取 引	日本	大阪取引 所	T R E I T 先 物 0 5 0 6 月 2 0 2 3 年 6 月	買建	20	日本・円	36,382,400	35,540,000	0.33

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

外国リート・インデックス・マザーファンド

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	340,109.77	45,100,000	45,387,217	0.18

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

参考情報

基準日: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



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

分配の推移

決算期	分配金
2022年9月	0円
2021年9月	0円
2020年9月	0円
2019年9月	0円
2018年9月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

主要な資産の状況

■三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	99.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.97
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	20.25
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	20.01
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	15.17
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	14.10
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	10.14
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	9.69
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	4.89
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	4.77

※比率は、ファンドの純資産総額に対する時価の比率です。

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

■国内債券パッシブ・マザーファンド

主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	国債証券	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

■ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.125	2025/01/31	1.72
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.500	2028/01/31	0.91
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.125	2028/11/15	0.88
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.000	2024/06/30	0.85
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.910	2028/10/14	0.69

■外国債券パッシブ・マザーファンド

主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2026/05/15	1.01
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

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

■国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	3.50
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

■外国株式インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	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

■エマージング株式インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	6.06
香港	投資信託受益証券	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	—	4.83
ケイマン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	4.29
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	—	3.63
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.27

※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。

■Jリート・インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	6.29
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	5.17
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	4.78
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	4.70
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	4.63

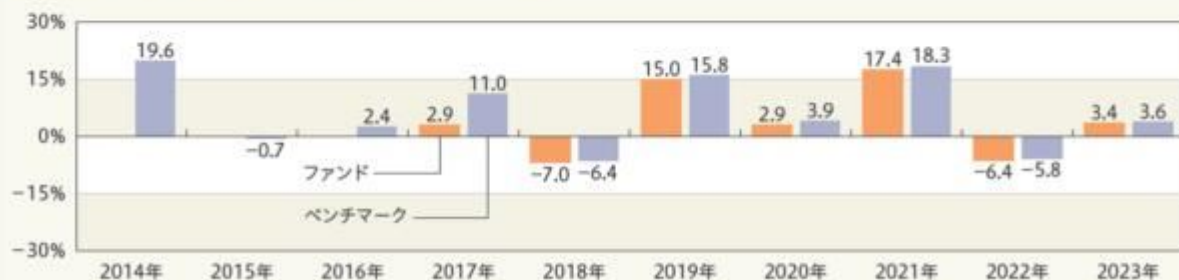
■外国リート・インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	8.98
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	5.20
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	3.74
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	3.15
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	2.83

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※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みを行っていただきます。

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

(ロ) 原則として午後3時まで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。

(二) 申込不可日

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

- ・ニューヨークの取引所の休業日
- ・ロンドンの取引所の休業日
- ・ニューヨークの銀行の休業日
- ・ロンドンの銀行の休業日

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

ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

ハ 申込手数料

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

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

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。

ただし、以下のいずれかに当たる場合には、解約請求の受付は行いません。

- ・ニューヨークの取引所の休業日
- ・ロンドンの取引所の休業日
- ・ニューヨークの銀行の休業日
- ・ロンドンの銀行の休業日

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

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して6営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

イ 基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入れ有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます（基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。）。投資対象とする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。

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、「DC世界分散」として掲載されます。委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	コールセンター	ホームページ
--------	---------	--------

三井住友D Sアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	https://www.smd-am.co.jp
-----------------------	--------------	---

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

(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】

2017年10月3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9月11日から翌年9月10日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

イ 信託の終了

(イ) 信託契約の解約

- a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、残存口数が10億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記aの事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
- 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。分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- b. 分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として決算日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)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、)に支払われます。

八 信託約款の変更等

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

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

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

- (ハ) 上記(ロ)の書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- (ニ) 書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います(書面決議は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。)
- (ホ) 上記(ロ)から(ニ)までの取扱いは、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- (ヘ) 上記にかかわらず、当ファンドと他のファンドとの併合の場合は、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、相手方となる他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、併合を行うことはできません。

二 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

ホ 販売会社との契約の更改等

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

へ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

ト 公告

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

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

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

チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ 分配金請求権

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

収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として決算日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、決算日

の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)に支払われます。

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

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

ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

ハ 一部解約実行請求権

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

ニ 書面決議における議決権

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

ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期(2021年9月11日から2022年9月12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・DCつみたてNISA・世界分散ファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 (2021年 9月10日現在)	第5期 (2022年 9月12日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	3,771,984	691,882
コール・ローン	7,308,256	19,446,501
親投資信託受益証券	1,005,072,758	1,618,812,630
未収入金	-	395,000
流動資産合計	1,016,152,998	1,639,346,013
資産合計	1,016,152,998	1,639,346,013
負債の部		
流動負債		
未払解約金	697,032	3,192,741
未払受託者報酬	97,172	158,101
未払委託者報酬	923,083	1,502,342
未払利息	16	-
その他未払費用	29,338	47,438
流動負債合計	1,746,641	4,900,622
負債合計	1,746,641	4,900,622
純資産の部		
元本等		
元本	788,236,116	1,214,217,954
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	226,170,241	420,227,437
(分配準備積立金)	147,041,387	202,112,152
元本等合計	1,014,406,357	1,634,445,391
純資産合計	1,014,406,357	1,634,445,391
負債純資産合計	1,016,152,998	1,639,346,013

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第4期		第5期	
	自	2020年 9月11日	自	2021年 9月11日
	至	2021年 9月10日	至	2022年 9月12日
営業収益				
受取利息		-		144
有価証券売買等損益		135,426,773		70,746,872
営業収益合計		135,426,773		70,747,016
営業費用				
支払利息		6,989		5,252
受託者報酬		166,314		282,953
委託者報酬		1,579,876		2,688,814
その他費用		50,718		85,293
営業費用合計		1,803,897		3,062,312
営業利益又は営業損失()		133,622,876		67,684,704
経常利益又は経常損失()		133,622,876		67,684,704
当期純利益又は当期純損失()		133,622,876		67,684,704
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()		6,726,357		1,424,141
期首剰余金又は期首欠損金()		36,576,009		226,170,241
剰余金増加額又は欠損金減少額		69,416,188		150,238,508
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		69,416,188		150,238,508
剰余金減少額又は欠損金増加額		6,718,475		22,441,875
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		6,718,475		22,441,875
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()		226,170,241		420,227,437

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第5期	
	自 2021年9月11日 至 2022年9月12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、2021年9月11日から2022年9月12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4期	第5期
	(2021年9月10日現在)	(2022年9月12日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	788,236,116口	1,214,217,954口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2869円 (1万口当たりの純資産額12,869円)	1口当たり純資産額 1.3461円 (1万口当たりの純資産額13,461円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第4期	第5期
	自 2020年9月11日 至 2021年9月10日	自 2021年9月11日 至 2022年9月12日

分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(14,720,294円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(112,176,225円)、収益調整金(79,128,854円)、および分配準備積立金(20,144,868円)より、分配対象収益は226,170,241円(1万口当たり2,869.28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(26,121,836円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(40,138,727円)、収益調整金(218,115,285円)、および分配準備積立金(135,851,589円)より、分配対象収益は420,227,437円(1万口当たり3,460.89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5期 自 2021年9月11日 至 2022年9月12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、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	第5期 (2022年9月12日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <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4期（自 2020年9月11日 至 2021年9月10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	132,052,645円

合計	132,052,645円
----	--------------

第5期(自 2021年9月11日 至 2022年9月12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	66,805,775円
合計	66,805,775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5期 自 2021年9月11日 至 2022年9月12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4期 (2021年9月10日現在)	第5期 (2022年9月12日現在)
期首元本額	508,204,609円	788,236,116円
期中追加設定元本額	357,578,274円	503,710,231円
期中一部解約元本額	77,546,767円	77,728,393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)	48,149,518	161,840,159	
	外国株式インデックス・マザーファンド	51,775,463	328,763,834	
	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	58,264,769	75,650,976	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	158,279,290	325,453,876	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	192,969,140	239,706,265	
	Jリート・インデックス・マザーファンド	28,910,457	80,001,016	
	外国リート・インデックス・マザーファンド	79,095,393	245,646,562	
	エマージング株式インデックス・マザーファンド	94,046,132	161,749,942	

	親投資信託受益証券 小計		1,618,812,630	
	合 計		1,618,812,630	

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・DCつみたてNISA・世界分散ファンドは、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「エマージング株式インデックス・マザーファンド」、「Jリート・インデックス・マザーファンド」および「外国リート・インデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内債券パッシブ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2021年9月10日現在)	(2022年9月12日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	163,328,371	15,404,179
コール・ローン	316,450,315	432,960,001
国債証券	111,186,696,550	104,003,852,680
地方債証券	8,765,062,560	10,290,112,600
特殊債券	11,461,135,766	9,372,625,977
社債券	4,847,751,000	6,035,333,600
未収入金	234,494,000	59,880,900
未収利息	414,991,081	361,877,661
前払費用	9,522,707	16,416,621
流動資産合計	137,399,432,350	130,588,464,219
資産合計	137,399,432,350	130,588,464,219
負債の部		
流動負債		
未払金	252,342,000	-
未払解約金	950,000	72,957,000
未払利息	698	-
その他未払費用	10,575	2,171
流動負債合計	253,303,273	72,959,171
負債合計	253,303,273	72,959,171
純資産の部		
元本等		
元本	106,912,762,885	105,070,373,916
剰余金		
剰余金又は欠損金()	30,233,366,192	25,445,131,132
元本等合計	137,146,129,077	130,515,505,048

純資産合計	137,146,129,077	130,515,505,048
負債純資産合計	137,399,432,350	130,588,464,219

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年9月11日 至 2022年9月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年9月10日現在)	(2022年9月12日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	106,912,762,885口	105,070,373,916口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2828円 (1万口当たりの純資産額12,828円)	1口当たり純資産額 1.2422円 (1万口当たりの純資産額12,422円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年9月11日 至 2022年9月12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</p> <p>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、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</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>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
<p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項 目	(2022年9月12日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p>

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2021年9月11日 至 2022年9月12日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2021年9月10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	103,519,056,378円
同期中における追加設定元本額	22,245,124,587円
同期中における一部解約元本額	18,851,418,080円
2021年9月10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)	6,429,803,140円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	11,214,547,439円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,529,755,566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)	729,407,076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)	43,884,113円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	195,944,976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)	468,973,163円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	671,004,512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)	316,080,055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)	457,744,477円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	140,646,417円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	2,523,302,649円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,185,930,120円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	494,355,889円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	40,627,015円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,610,363,164円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	543,175,156円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	815,757,476円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	177,111,519円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	66,210,475円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	117,119,573円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	101,694,341円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	177,170,415円

三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	51,142,584円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	5,576,866円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,580,848,669円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	13,700,918,277円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	6,645,250,132円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	16,655,431,933円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	331,211,562円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	592,548,396円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	273,591,100円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	120,352,684円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,879,386,729円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,201,700,349円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,458,947,061円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	9,018,958,610円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	964,528円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,249,600,072円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	465,435,023円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	570,338,804円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	178,863,776円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	43,132,304円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,544,859,838円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,226,859,326円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	753,200,032円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	209,761,569円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	19,071,373円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	284,228,228円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	5,448,462,272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>	416,502,680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>	820,434,999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>	889,288,444円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	5,225,285,939円
合計	106,912,762,885円

(2022年9月12日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	106,912,762,885円
同期中における追加設定元本額	24,077,751,218円
同期中における一部解約元本額	25,920,140,187円
2022年9月12日現在の元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	7,405,294,843円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	12,270,168,802円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,846,992,295円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	823,848,056円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	41,070,800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)	188,185,362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)	504,029,049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)	879,417,622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)	450,102,528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)	581,272,184円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	140,807,106円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,924,964,674円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,056,053,003円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	422,825,277円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	57,571,397円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,949,732,234円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	654,426,007円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	970,730,653円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	217,690,587円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	35,698,724円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	192,969,140円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	283,890,678円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	506,037,343円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	144,781,815円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	8,007,380円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,217,386,473円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	11,436,365,442円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	6,128,242,930円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	15,401,942,052円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	306,310,460円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	526,289,799円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	257,205,778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>	119,981,072円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,802,337,039円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,124,463,694円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,254,065,737円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	8,157,611,864円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	961,967円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,109,862,458円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	415,038,581円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	499,895,584円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	170,458,356円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	43,709,085円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,352,499,366円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,036,009,210円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	649,577,213円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	210,001,663円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	20,814,251円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	265,467,132円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	4,985,334,340円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	1,213,665,167円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	1,185,737,715円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	1,518,563,091円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	5,104,008,838円

合計

105,070,373,916円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	4 3 8 2年国債	5,770,000,000	5,779,347,400	
	4 3 9 2年国債	1,000,000,000	1,001,690,000	
	1 4 1 5年国債	795,000,000	797,973,300	
	1 4 2 5年国債	760,000,000	763,192,000	
	1 4 3 5年国債	770,000,000	773,488,100	
	1 4 4 5年国債	980,000,000	984,890,200	
	1 4 5 5年国債	1,180,000,000	1,186,065,200	
	1 4 6 5年国債	1,000,000,000	1,005,400,000	
	1 4 7 5年国債	1,540,000,000	1,543,511,200	
	1 4 8 5年国債	1,730,000,000	1,733,909,800	
	1 4 9 5年国債	1,240,000,000	1,241,984,000	
	1 5 0 5年国債	1,270,000,000	1,270,812,800	
	1 5 1 5年国債	230,000,000	229,894,200	
	1 5 2 5年国債	340,000,000	341,224,000	
	1 5 3 5年国債	1,550,000,000	1,546,667,500	
	1 4 0年国債	40,000,000	50,866,800	
	2 4 0年国債	242,000,000	296,338,680	
	3 4 0年国債	185,000,000	227,501,900	
	4 4 0年国債	247,000,000	303,669,210	
	5 4 0年国債	235,000,000	277,485,650	
	6 4 0年国債	240,000,000	276,597,600	
	7 4 0年国債	265,000,000	292,289,700	
	8 4 0年国債	310,000,000	317,446,200	
	9 4 0年国債	493,000,000	371,219,140	
	1 0 4 0年国債	460,000,000	407,422,000	
	1 1 4 0年国債	360,000,000	307,666,800	
	1 2 4 0年国債	370,000,000	282,705,900	
	1 3 4 0年国債	475,000,000	360,966,750	
	1 4 4 0年国債	515,000,000	418,509,600	
	1 5 4 0年国債	230,000,000	204,253,800	
	3 3 5 10年国債	90,000,000	91,064,700	
	3 3 6 10年国債	340,000,000	344,518,600	
	3 3 7 10年国債	120,000,000	121,050,000	
	3 3 8 10年国債	805,000,000	814,732,450	
3 3 9 10年国債	785,000,000	795,448,350		
3 4 0 10年国債	770,000,000	780,949,400		
3 4 1 10年国債	557,000,000	563,656,150		

3 4 2	1 0 年国債	350,000,000	351,970,500	
3 4 3	1 0 年国債	310,000,000	311,813,500	
3 4 4	1 0 年国債	811,000,000	815,403,730	
3 4 5	1 0 年国債	258,000,000	259,210,020	
3 4 6	1 0 年国債	340,000,000	341,302,200	
3 4 7	1 0 年国債	100,000,000	100,285,000	
3 4 8	1 0 年国債	545,000,000	546,226,250	
3 4 9	1 0 年国債	980,000,000	981,538,600	
3 5 0	1 0 年国債	390,000,000	390,319,800	
3 5 1	1 0 年国債	390,000,000	390,000,000	
3 5 2	1 0 年国債	430,000,000	429,742,000	
3 5 3	1 0 年国債	450,000,000	449,577,000	
3 5 4	1 0 年国債	725,000,000	723,825,500	
3 5 5	1 0 年国債	550,000,000	548,520,500	
3 5 6	1 0 年国債	310,000,000	308,815,800	
3 5 7	1 0 年国債	1,410,000,000	1,401,399,000	
3 5 8	1 0 年国債	1,080,000,000	1,070,809,200	
3 5 9	1 0 年国債	1,020,000,000	1,010,259,000	
3 6 0	1 0 年国債	1,130,000,000	1,117,988,100	
3 6 1	1 0 年国債	1,000,000,000	988,240,000	
3 6 2	1 0 年国債	1,180,000,000	1,164,754,400	
3 6 3	1 0 年国債	1,300,000,000	1,282,164,000	
3 6 5	1 0 年国債	1,050,000,000	1,037,610,000	
3 6 6	1 0 年国債	240,000,000	240,000,000	
3 6 7	1 0 年国債	2,470,000,000	2,459,379,000	
2	3 0 年国債	510,000,000	592,665,900	
4	3 0 年国債	340,000,000	413,273,400	
5	3 0 年国債	290,000,000	338,340,100	
7	3 0 年国債	474,000,000	566,121,900	
9	3 0 年国債	240,000,000	266,164,800	
1 0	3 0 年国債	465,000,000	501,637,350	
1 1	3 0 年国債	430,000,000	490,741,800	
1 2	3 0 年国債	570,000,000	675,472,800	
1 4	3 0 年国債	622,000,000	760,189,740	
1 6	3 0 年国債	465,000,000	575,990,850	
1 8	3 0 年国債	190,000,000	231,781,000	
1 9	3 0 年国債	470,000,000	573,935,800	
2 1	3 0 年国債	345,000,000	422,531,850	
2 2	3 0 年国債	315,000,000	394,754,850	
2 3	3 0 年国債	329,000,000	412,954,220	
2 4	3 0 年国債	310,000,000	389,691,700	
2 5	3 0 年国債	290,000,000	357,140,800	
2 6	3 0 年国債	363,000,000	452,356,080	
2 7	3 0 年国債	250,000,000	315,877,500	
2 8	3 0 年国債	386,000,000	488,363,340	

29	30年国債	177,000,000	221,618,160	
30	30年国債	212,000,000	262,407,240	
31	30年国債	325,000,000	397,322,250	
32	30年国債	360,000,000	446,385,600	
33	30年国債	368,000,000	438,236,480	
34	30年国債	87,000,000	106,469,730	
35	30年国債	340,000,000	405,341,200	
36	30年国債	90,000,000	107,414,100	
37	30年国債	405,000,000	476,122,050	
38	30年国債	380,000,000	439,606,800	
39	30年国債	220,000,000	258,491,200	
40	30年国債	270,000,000	312,122,700	
41	30年国債	270,000,000	306,641,700	
42	30年国債	280,000,000	317,797,200	
43	30年国債	225,000,000	255,206,250	
44	30年国債	290,000,000	328,706,300	
45	30年国債	355,000,000	388,032,750	
46	30年国債	315,000,000	343,942,200	
47	30年国債	280,000,000	311,152,800	
48	30年国債	455,000,000	486,322,200	
49	30年国債	315,000,000	336,243,600	
50	30年国債	325,000,000	305,925,750	
51	30年国債	315,000,000	262,813,950	
52	30年国債	303,000,000	264,437,190	
53	30年国債	277,000,000	246,920,570	
54	30年国債	75,000,000	69,846,000	
55	30年国債	295,000,000	274,040,250	
56	30年国債	390,000,000	361,023,000	
57	30年国債	355,000,000	327,466,200	
58	30年国債	480,000,000	441,201,600	
59	30年国債	350,000,000	313,092,500	
60	30年国債	330,000,000	308,533,500	
61	30年国債	255,000,000	226,368,600	
62	30年国債	195,000,000	163,755,150	
63	30年国債	220,000,000	179,082,200	
64	30年国債	305,000,000	247,388,550	
65	30年国債	295,000,000	239,380,700	
66	30年国債	310,000,000	251,670,400	
67	30年国債	320,000,000	272,352,000	
68	30年国債	350,000,000	297,237,500	
69	30年国債	370,000,000	322,773,200	
70	30年国債	350,000,000	304,412,500	
71	30年国債	390,000,000	338,523,900	
72	30年国債	260,000,000	225,230,200	
73	30年国債	290,000,000	250,980,500	

7 4	3 0 年国債	350,000,000	327,253,500	
7 5	3 0 年国債	430,000,000	431,853,300	
7 2	2 0 年国債	753,000,000	786,275,070	
7 4	2 0 年国債	664,000,000	696,974,240	
7 5	2 0 年国債	490,000,000	516,915,700	
7 8	2 0 年国債	590,000,000	622,396,900	
8 2	2 0 年国債	620,000,000	660,703,000	
8 4	2 0 年国債	500,000,000	533,815,000	
8 5	2 0 年国債	645,000,000	693,949,050	
8 8	2 0 年国債	742,000,000	807,956,380	
8 9	2 0 年国債	20,000,000	21,702,400	
9 0	2 0 年国債	580,000,000	632,171,000	
9 2	2 0 年国債	424,000,000	462,202,400	
9 3	2 0 年国債	632,000,000	688,601,920	
9 5	2 0 年国債	305,000,000	337,796,650	
9 7	2 0 年国債	327,000,000	362,106,720	
9 9	2 0 年国債	153,000,000	169,302,150	
1 0 0	2 0 年国債	207,000,000	231,094,800	
1 0 1	2 0 年国債	355,000,000	400,219,900	
1 0 2	2 0 年国債	457,000,000	517,415,400	
1 0 5	2 0 年国債	390,000,000	436,534,800	
1 0 6	2 0 年国債	370,000,000	416,361,000	
1 0 7	2 0 年国債	378,000,000	424,826,640	
1 0 8	2 0 年国債	390,000,000	433,457,700	
1 0 9	2 0 年国債	140,000,000	156,108,400	
1 1 1	2 0 年国債	386,000,000	439,596,100	
1 1 3	2 0 年国債	227,000,000	257,835,680	
1 1 4	2 0 年国債	263,000,000	299,336,080	
1 1 6	2 0 年国債	100,000,000	114,807,000	
1 1 8	2 0 年国債	200,000,000	227,272,000	
1 1 9	2 0 年国債	295,000,000	330,718,600	
1 2 0	2 0 年国債	200,000,000	221,160,000	
1 2 1	2 0 年国債	55,000,000	62,280,900	
1 2 2	2 0 年国債	330,000,000	371,085,000	
1 2 3	2 0 年国債	80,000,000	92,138,400	
1 2 4	2 0 年国債	190,000,000	217,287,800	
1 2 5	2 0 年国債	205,000,000	238,527,750	
1 2 6	2 0 年国債	180,000,000	206,434,800	
1 2 7	2 0 年国債	145,000,000	165,083,950	
1 2 8	2 0 年国債	65,000,000	74,232,600	
1 3 0	2 0 年国債	155,000,000	176,424,100	
1 3 1	2 0 年国債	380,000,000	429,164,400	
1 3 2	2 0 年国債	450,000,000	510,030,000	
1 3 3	2 0 年国債	190,000,000	217,069,300	
1 3 4	2 0 年国債	200,000,000	228,916,000	

135	20年国債	155,000,000	175,969,950	
136	20年国債	120,000,000	135,118,800	
137	20年国債	185,000,000	210,474,500	
139	20年国債	60,000,000	67,690,200	
140	20年国債	340,000,000	387,239,600	
142	20年国債	190,000,000	218,389,800	
143	20年国債	150,000,000	169,531,500	
144	20年国債	170,000,000	190,405,100	
145	20年国債	110,000,000	125,538,600	
146	20年国債	215,000,000	245,534,300	
147	20年国債	260,000,000	294,275,800	
148	20年国債	219,000,000	245,516,520	
149	20年国債	495,000,000	555,251,400	
150	20年国債	391,000,000	434,096,020	
151	20年国債	530,000,000	575,876,800	
152	20年国債	595,000,000	646,336,600	
153	20年国債	437,000,000	479,817,260	
154	20年国債	380,000,000	412,262,000	
155	20年国債	410,000,000	434,157,200	
156	20年国債	460,000,000	450,749,400	
157	20年国債	555,000,000	527,771,700	
158	20年国債	380,000,000	375,569,200	
159	20年国債	388,000,000	387,743,920	
160	20年国債	445,000,000	449,739,250	
161	20年国債	380,000,000	377,948,000	
162	20年国債	410,000,000	406,638,000	
163	20年国債	430,000,000	425,239,900	
164	20年国債	405,000,000	393,388,650	
165	20年国債	410,000,000	396,945,600	
166	20年国債	515,000,000	512,780,350	
167	20年国債	380,000,000	365,693,000	
168	20年国債	450,000,000	424,669,500	
169	20年国債	400,000,000	369,884,000	
170	20年国債	385,000,000	354,569,600	
171	20年国債	385,000,000	353,379,950	
172	20年国債	480,000,000	446,726,400	
173	20年国債	365,000,000	338,340,400	
174	20年国債	990,000,000	914,661,000	
175	20年国債	565,000,000	529,953,050	
176	20年国債	550,000,000	513,859,500	
177	20年国債	560,000,000	512,573,600	
178	20年国債	480,000,000	446,640,000	
179	20年国債	370,000,000	343,437,700	
180	20年国債	500,000,000	489,665,000	
181	20年国債	760,000,000	756,823,200	

	国債証券 小計		104,003,852,680	
地方債証券	7 2 7 東京都公債	500,000,000	504,576,000	
	7 9 2 東京都公債	300,000,000	296,265,600	
	1 東京都30年	100,000,000	118,090,900	
	8 東京都30年	400,000,000	485,788,800	
	1 3 東京都30年	500,000,000	585,876,500	
	1 東京都20年	100,000,000	101,232,300	
	6 東京都20年	100,000,000	104,893,200	
	2 6 - 1 5 北海道公債	100,000,000	100,929,100	
	3 0 - 1 8 北海道公債	200,000,000	198,434,600	
	2 1 0 神奈川県公債	100,000,000	100,918,800	
	2 1 1 神奈川県公債	100,000,000	100,887,100	
	1 神奈川県20年	100,000,000	104,431,800	
	3 神奈川県20年	100,000,000	105,700,900	
	7 神奈川県20年	100,000,000	109,425,600	
	1 3 神奈川県20年	100,000,000	113,672,400	
	3 7 3 大阪府公債	100,000,000	100,756,500	
	3 7 7 大阪府公債	100,000,000	100,832,800	
	3 8 8 大阪府公債	100,000,000	100,997,000	
	3 9 2 大阪府公債	100,000,000	100,722,300	
	1 9 3 大阪府5年	300,000,000	298,056,000	
	2 7 - 4 京都府公債	100,000,000	101,384,300	
	2 9 - 1 2 京都府5年	300,000,000	300,109,800	
	1 - 6 京都府5年	200,000,000	199,822,400	
	5 兵庫県公債15年	300,000,000	318,263,700	
	1 0 兵庫県公債20年	100,000,000	113,881,800	
	7 静岡県30年	100,000,000	117,705,800	
	1 静岡県20年	100,000,000	106,389,000	
	2 2 - 8 愛知県20年	200,000,000	223,919,200	
	2 7 - 1 6 愛知県公債	400,000,000	405,190,400	
	2 5 - 1 1 福岡県公債	100,000,000	100,979,500	
	2 6 - 3 福岡県公債	100,000,000	101,003,900	
	2 6 - 1 0 福岡県公債	100,000,000	100,989,900	
	1 - 1 福岡県公債	200,000,000	196,783,600	
	1 - 3 福岡県30年	100,000,000	79,743,300	
	2 5 - 8 千葉県公債	100,000,000	100,804,000	
	2 6 - 4 千葉県公債	100,000,000	101,037,200	
	1 3 7 共同発行地方	200,000,000	202,027,000	
	1 3 8 共同発行地方	200,000,000	202,074,400	
	1 7 2 共同発行地方	500,000,000	501,695,500	
	1 8 3 共同発行地方	600,000,000	599,554,800	
1 - 1 大阪市5年	300,000,000	299,858,100		
1 名古屋市20年	200,000,000	205,049,000		
3 名古屋市20年	100,000,000	105,470,900		
5 名古屋市20年	100,000,000	108,887,000		

	29 - 5 京都市5年	100,000,000	100,037,300	
	1 京都市30年	100,000,000	125,888,700	
	7 京都市20年	100,000,000	112,789,300	
	26 - 17 神戸市公債	100,000,000	100,545,400	
	26 - 3 横浜市公債	200,000,000	202,026,400	
	4 横浜市20年	100,000,000	104,963,200	
	9 横浜市20年	100,000,000	108,595,000	
	14 横浜市20年	100,000,000	111,596,800	
	26 - 4 札幌市公債	100,000,000	100,877,100	
	94 川崎市公債	100,000,000	97,660,600	
	1 - 2 北九州市5年	100,000,000	99,910,300	
	29 - 11 福岡市5年	300,000,000	300,109,800	
	地方債証券 小計		10,290,112,600	
特殊債券	47 日本政策投資CO	100,000,000	104,697,200	
	3 政保政策投資CO	200,000,000	205,464,400	
	36 日本政策投資B	100,000,000	109,339,800	
	18 道路機構	100,000,000	133,016,100	
	22 道路機構	300,000,000	386,240,400	
	27 道路機構	100,000,000	110,520,300	
	37 道路機構	300,000,000	336,339,000	
	47 道路機構	200,000,000	227,195,800	
	104 道路機構	400,000,000	401,447,600	
	79 政保道路機構	200,000,000	225,143,200	
	81 政保道路機構	200,000,000	225,404,600	
	88 政保道路機構	100,000,000	123,293,000	
	90 政保道路機構	500,000,000	565,947,500	
	99 政保道路機構	100,000,000	114,241,500	
	176 政保道路機構	100,000,000	112,700,700	
	196 政保道路機構	100,000,000	114,110,700	
	210 政保道路機構	200,000,000	223,497,600	
	227 政保道路機構	200,000,000	202,349,800	
	231 政保道路機構	300,000,000	303,462,000	
	288 政保道路機構	189,000,000	188,888,301	
	9 道路債券	100,000,000	123,251,800	
	2 地方公営20年	100,000,000	112,862,300	
	61 地方公共団体	100,000,000	101,077,800	
	62 地方公共団体	400,000,000	404,044,000	
	63 地方公共団体	100,000,000	100,953,800	
	64 地方公共団体	100,000,000	100,986,000	
	67 政保地方公共団	100,000,000	101,115,400	
	101 地方公共団体	100,000,000	99,944,800	
	106 地方公共団体	200,000,000	199,318,000	
	3 公営企業20年	100,000,000	100,529,800	
	5 公営企業20年	100,000,000	102,133,200	
	17 公営企業20年	100,000,000	107,985,200	

2 0	公営企業 2 0 年	100,000,000	109,273,200	
2 2	公営企業 2 0 年	100,000,000	109,949,100	
2 4	公営企業 2 0 年	200,000,000	222,376,000	
5 2	住宅支援機構	100,000,000	112,122,600	
1 3 0	住宅支援機構	200,000,000	224,699,600	
2 2 6	住宅支援機構	100,000,000	99,838,800	
S 9	住宅金融 R M B S	19,576,000	19,603,406	
S 1 0	住宅金融 R M B S	30,096,000	30,402,979	
S 3	住宅機構 R M B S	10,541,000	10,647,464	
S 5	住宅機構 R M B S	22,522,000	22,898,117	
S 7	住宅機構 R M B S	11,518,000	11,706,895	
S 9	住宅機構 R M B S	11,783,000	12,089,358	
S 1 0	住宅機構 R M B S	11,553,000	11,762,109	
S 1 1	住宅機構 R M B S	12,427,000	12,783,654	
2 9	住宅金融 R M B S	9,713,000	9,723,684	
3 2	住宅金融 R M B S	10,482,000	10,560,615	
3 5	住宅金融 R M B S	11,306,000	11,484,634	
3 9	住宅金融 R M B S	10,267,000	10,354,269	
4 1	住宅金融 R M B S	10,975,000	11,164,867	
4 3	住宅金融 R M B S	21,014,000	21,247,255	
5 1	住宅金融 R M B S	10,021,000	10,124,216	
5 3	住宅金融 R M B S	10,766,000	10,955,481	
1	住宅機構 R M B S	19,674,000	19,699,576	
2	住宅機構 R M B S	22,184,000	22,612,151	
4	住宅機構 R M B S	10,233,000	10,346,586	
6	住宅機構 R M B S	10,282,000	10,386,876	
1 9	住宅機構 R M B S	15,064,000	15,740,373	
2 4	住宅機構 R M B S	30,576,000	32,126,203	
2 6	住宅機構 R M B S	47,922,000	50,260,593	
2 7	住宅機構 R M B S	17,047,000	17,914,692	
2 8	住宅機構 R M B S	19,097,000	20,174,070	
2 9	住宅機構 R M B S	21,061,000	22,328,872	
3 0	住宅機構 R M B S	20,978,000	22,255,560	
3 2	住宅機構 R M B S	41,000,000	43,181,200	
3 5	住宅機構 R M B S	20,747,000	21,881,860	
3 6	住宅機構 R M B S	20,175,000	21,209,977	
4 3	住宅機構 R M B S	25,659,000	27,016,361	
4 6	住宅機構 R M B S	20,147,000	21,202,702	
4 8	住宅機構 R M B S	38,000,000	39,911,400	
4 9	住宅機構 R M B S	19,277,000	20,171,452	
5 1	住宅機構 R M B S	42,368,000	44,304,217	
5 5	住宅機構 R M B S	56,420,000	58,896,838	
5 7	住宅機構 R M B S	27,087,000	28,278,828	
5 8	住宅機構 R M B S	30,130,000	31,485,850	
5 9	住宅機構 R M B S	57,586,000	60,211,921	

	6 0 住宅機構R M B S	88,662,000	92,341,473	
	6 1 住宅機構R M B S	29,947,000	31,087,980	
	6 7 住宅機構R M B S	37,617,000	38,820,744	
	6 9 住宅機構R M B S	77,304,000	80,450,272	
	7 0 住宅機構R M B S	67,788,000	70,370,722	
	7 3 住宅機構R M B S	38,642,000	40,249,507	
	9 9 住宅機構R M B S	58,607,000	59,720,533	
	1 2 3 住宅機構R M B S	76,580,000	75,561,486	
	1 2 4 住宅機構R M B S	76,584,000	75,335,680	
	1 2 5 住宅機構R M B S	76,534,000	75,271,189	
	1 2 7 住宅機構R M B S	78,359,000	76,870,179	
	1 2 8 住宅機構R M B S	77,402,000	76,070,685	
	1 2 9 住宅機構R M B S	79,134,000	77,939,076	
	1 3 7 住宅機構R M B S	81,381,000	80,005,661	
	1 6 7 住宅機構R M B S	94,243,000	92,056,562	
	1 8 3 住宅機構R M B S	199,726,000	196,470,466	
	8 5 中日本高速道	300,000,000	299,135,700	
	特殊債券 小計		9,372,625,977	
社債券	2 BPCE S.A.	200,000,000	199,987,000	
	8 6 東日本高速道	200,000,000	198,370,400	
	2 0 西日本高速道	100,000,000	100,704,600	
	2 3 西日本高速道	100,000,000	100,847,700	
	1 3 大和ハウス	100,000,000	99,805,300	
	1 7 アサヒグループHD	200,000,000	199,647,800	
	3 0 東レ	100,000,000	100,050,400	
	5 6 住友化学	200,000,000	199,211,600	
	2 4 三菱ケミカルホールデイ	100,000,000	99,438,000	
	1 6 日立製作所	100,000,000	100,934,500	
	2 2 パナソニック	100,000,000	99,117,100	
	9 TDK	100,000,000	97,903,400	
	6 3 三井物産	100,000,000	109,415,400	
	8 みずほコーポレート	100,000,000	110,320,000	
	1 三井住友F G劣後	100,000,000	100,866,000	
	8 住友信託 劣後	100,000,000	108,393,000	
	1 みずほF G劣後	100,000,000	100,820,000	
	9 みずほ銀行劣後	100,000,000	108,439,500	
	1 7 NTTファイナンス	200,000,000	199,337,200	
	7 3 ホンダファイナンス	200,000,000	198,944,400	
	2 0 7 オリックス	200,000,000	198,526,000	
	2 三菱HCキャピタル	200,000,000	197,688,800	
	1 野村ホールディングス	100,000,000	100,014,000	
	5 8 三菱地所	100,000,000	121,821,300	
	1 3 5 三菱地所	200,000,000	194,334,600	
	1 0 東急	100,000,000	96,901,400	
	3 8 京王電鉄	100,000,000	99,799,600	

1 1 0 東日本旅客鉄	100,000,000	110,640,800	
1 6 9 東日本旅客鉄	200,000,000	193,751,600	
4 1 東海旅客鉄道	100,000,000	111,421,300	
4 2 東海旅客鉄道	100,000,000	112,712,300	
4 5 東京地下鉄	100,000,000	97,745,300	
6 4 阪急阪神H L D G	100,000,000	99,327,500	
5 4 6 中部電力	200,000,000	191,325,000	
5 5 3 中部電力	200,000,000	198,504,400	
5 5 0 関西電力	300,000,000	298,848,600	
5 0 8 東北電力	200,000,000	197,541,200	
5 4 7 東北電力	100,000,000	98,887,900	
4 9 6 九州電力	300,000,000	287,979,600	
3 8 東京電力パワー	100,000,000	100,167,900	
4 1 大阪瓦斯	200,000,000	194,733,000	
7 ファーストリテイリング	100,000,000	100,108,200	
社債券 小計		6,035,333,600	
合 計		129,701,924,857	

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。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位 : 円)

	(2021年9月10日現在)	(2022年9月12日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	28,230,847	40,066,476
金銭信託	46,197,872	4,633,429
コール・ローン	89,508,827	130,230,195
国債証券	25,996,834,784	26,458,313,532
派生商品評価勘定	76,050,089	-
未収入金	-	347,174
未収利息	103,268,257	122,417,680
前払費用	16,220,442	32,362,060
流動資産合計	26,356,311,118	26,788,370,546
資産合計	26,356,311,118	26,788,370,546
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	8,174,992	677,805,939
未払金	-	4,017,074
未払解約金	4,000,000	78,399,999
未払利息	197	-
その他未払費用	5,858	963
流動負債合計	12,181,047	760,223,975
負債合計	12,181,047	760,223,975

純資産の部		
元本等		
元本	17,348,369,874	20,045,986,946
剰余金		
剰余金又は欠損金()	8,995,760,197	5,982,159,625
元本等合計	26,344,130,071	26,028,146,571
純資産合計	26,344,130,071	26,028,146,571
負債純資産合計	26,356,311,118	26,788,370,546

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年9月11日 至 2022年9月12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	(2021年9月10日現在)	(2022年9月12日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	17,348,369,874口	20,045,986,946口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.5185円 (1万口当たりの純資産額15,185円)	1口当たり純資産額 1.2984円 (1万口当たりの純資産額12,984円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年9月11日 至 2022年9月12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、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

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

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年9月12日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年9月10日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建				
	アメリカ・ドル	11,975,159,024	-	11,928,042,984	47,116,040
	イギリス・ポンド	1,636,445,041	-	1,642,201,150	5,756,109
	イスラエル・シケル	120,802,017	-	120,563,872	238,145
	オーストラリア・ドル	485,561,160	-	486,972,850	1,411,690
	カナダ・ドル	517,271,409	-	513,864,150	3,407,259
	シンガポール・ドル	241,569,305	-	241,059,250	510,055
	スウェーデン・クローナ	76,726,905	-	76,635,313	91,592
	デンマーク・クローネ	134,909,117	-	134,616,600	292,517
	ノルウェー・クローネ	63,160,376	-	63,129,987	30,389
	ポーランド・ズロチ	153,611,554	-	152,767,645	843,909
	メキシコ・ペソ	187,361,443	-	188,368,636	1,007,193
	ユーロ	10,582,515,583	-	10,558,995,400	23,520,183
	小計	26,175,092,934	-	26,107,217,837	67,875,097
合計	26,175,092,934	-	26,107,217,837	67,875,097	

(2022年9月12日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち 1年超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	13,537,941,900	-	13,863,496,764	325,554,864
	カナダ・ドル	549,654,508	-	568,885,200	19,230,692
	オーストラリア・ド ル	406,652,232	-	418,476,630	11,824,398
	シンガポール・ドル	255,385,269	-	261,701,301	6,316,032
	イギリス・ポンド	1,207,560,495	-	1,239,904,337	32,343,842
	イスラエル・シユケ ル	102,531,296	-	102,966,990	435,694
	デンマーク・クロー ネ	96,995,512	-	99,744,348	2,748,836
	ノルウェー・クロー ネ	53,836,115	-	55,665,060	1,828,945
	スウェーデン・ク ローナ	66,863,394	-	69,104,691	2,241,297
	メキシコ・ペソ	213,210,399	-	222,269,748	9,059,349
	オフショア・人民元	750,597,731	-	766,242,378	15,644,647
	ポーランド・ズロチ	113,156,055	-	117,516,542	4,360,487
	ユーロ	8,771,610,386	-	9,017,827,242	246,216,856
	小計	26,125,995,292	-	26,803,801,231	677,805,939
	合 計	26,125,995,292	-	26,803,801,231	677,805,939

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2021年9月11日 至 2022年9月12日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2021年9月10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	14,934,455,373円
同期中における追加設定元本額	11,195,951,243円
同期中における一部解約元本額	8,782,036,742円
2021年9月10日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	3,211,662,342円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	2,011,067,137円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	842,192,518円
イオン・バランス戦略ファンド	888,469,164円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,479,467,989円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	556,318,037円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	920,172,878円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	209,296,565円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	57,326,299円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	32,203,455円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)	655,738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>	1,339,079,645円
S M A M・バランスV A株40T<適格機関投資家限定>	820,208円
S M A M・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	5,102,138,648円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	141,277,611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>	266,955,679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>	289,265,961円
合 計	17,348,369,874円

(2022年9月12日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	17,348,369,874円
同期中における追加設定元本額	10,681,951,147円
同期中における一部解約元本額	7,984,334,075円
2022年9月12日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	3,259,160,926円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	2,004,157,726円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	812,805,747円
イオン・バランス戦略ファンド	1,038,428,645円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	2,458,848,150円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	922,475,104円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	1,688,186,609円

三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)	414,613,223円
三井住友・資産最適化ファンド(5 成長重視型)	135,457,382円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	58,264,769円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)	509,015,574円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,154,681,049円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	885,316円
SMAM・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	4,427,439,289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>	354,629,080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>	354,304,415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>	452,633,942円
合計	20,045,986,946円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	T 0.125 01/15/24	600,000.00	573,042.00	
		T 0.125 02/15/24	1,050,000.00	1,000,282.50	
		T 0.125 10/15/23	1,090,000.00	1,049,844.40	
		T 0.25 03/15/24	890,000.00	846,817.20	
		T 0.25 05/15/24	530,000.00	501,592.00	
		T 0.25 05/31/25	370,000.00	338,057.90	
		T 0.25 06/15/24	620,000.00	585,168.40	
		T 0.25 06/30/25	650,000.00	592,566.00	
		T 0.25 08/31/25	590,000.00	534,410.20	
		T 0.25 09/30/25	290,000.00	262,107.80	
		T 0.25 10/31/25	420,000.00	378,373.80	
		T 0.25 11/15/23	500,000.00	481,250.00	
		T 0.375 01/31/26	330,000.00	296,224.50	
		T 0.375 04/30/25	320,000.00	294,249.60	
		T 0.375 07/31/27	650,000.00	560,826.50	
		T 0.375 08/15/24	410,000.00	385,879.70	
		T 0.375 09/15/24	700,000.00	656,901.00	
		T 0.375 09/30/27	470,000.00	403,133.10	
		T 0.375 11/30/25	350,000.00	315,805.00	
		T 0.375 12/31/25	620,000.00	558,117.80	
		T 0.5 02/28/26	940,000.00	845,407.80	
		T 0.5 03/31/25	420,000.00	388,500.00	
		T 0.5 04/30/27	480,000.00	419,400.00	
T 0.5 05/31/27	370,000.00	322,432.80			
T 0.5 06/30/27	710,000.00	617,643.20			
T 0.5 08/31/27	640,000.00	553,996.80			

T 0.5 10/31/27	780,000.00	671,712.60	
T 0.5 11/30/23	200,000.00	192,796.00	
T 0.625 03/31/27	520,000.00	458,166.80	
T 0.625 05/15/30	870,000.00	710,407.20	
T 0.625 07/31/26	720,000.00	643,946.40	
T 0.625 08/15/30	1,050,000.00	852,631.50	
T 0.625 10/15/24	230,000.00	216,450.70	
T 0.625 11/30/27	580,000.00	501,584.00	
T 0.625 12/31/27	350,000.00	301,983.50	
T 0.75 01/31/28	710,000.00	615,946.30	
T 0.75 03/31/26	720,000.00	651,960.00	
T 0.75 08/31/26	160,000.00	143,518.40	
T 0.75 11/15/24	660,000.00	621,066.60	
T 0.75 12/31/23	980,000.00	945,082.60	
T 0.875 01/31/24	900,000.00	867,159.00	
T 0.875 06/30/26	500,000.00	452,440.00	
T 0.875 09/30/26	340,000.00	305,959.20	
T 0.875 11/15/30	1,100,000.00	909,898.00	
T 1 07/31/28	650,000.00	565,240.00	
T 1 12/15/24	600,000.00	566,574.00	
T 1.125 01/15/25	500,000.00	472,460.00	
T 1.125 02/15/31	1,040,000.00	874,816.80	
T 1.125 02/28/27	280,000.00	252,929.60	
T 1.125 02/29/28	650,000.00	574,840.50	
T 1.125 05/15/40	270,000.00	179,442.00	
T 1.125 08/15/40	380,000.00	249,758.80	
T 1.125 08/31/28	490,000.00	428,460.90	
T 1.125 10/31/26	500,000.00	453,885.00	
T 1.25 03/31/28	660,000.00	586,159.20	
T 1.25 04/30/28	730,000.00	646,984.40	
T 1.25 05/15/50	530,000.00	315,429.50	
T 1.25 05/31/28	580,000.00	513,433.40	
T 1.25 06/30/28	480,000.00	423,936.00	
T 1.25 08/15/31	1,120,000.00	941,673.60	
T 1.25 08/31/24	450,000.00	430,452.00	
T 1.25 09/30/28	560,000.00	492,469.60	
T 1.25 11/30/26	400,000.00	364,512.00	
T 1.25 12/31/26	730,000.00	664,300.00	
T 1.375 01/31/25	430,000.00	408,297.90	
T 1.375 08/15/50	680,000.00	418,676.00	
T 1.375 08/31/26	470,000.00	432,729.00	
T 1.375 10/31/28	180,000.00	159,312.60	
T 1.375 11/15/31	1,010,000.00	854,631.70	
T 1.375 11/15/40	530,000.00	363,712.50	

T 1.375 12/31/28	720,000.00	636,184.80	
T 1.5 01/31/27	350,000.00	321,573.00	
T 1.5 02/15/25	260,000.00	247,304.20	
T 1.5 02/15/30	570,000.00	501,018.60	
T 1.5 08/15/26	550,000.00	508,788.50	
T 1.5 11/30/24	510,000.00	487,605.90	
T 1.5 11/30/28	380,000.00	338,333.00	
T 1.625 02/15/26	600,000.00	562,074.00	
T 1.625 05/15/26	570,000.00	532,214.70	
T 1.625 05/15/31	930,000.00	812,001.60	
T 1.625 08/15/29	420,000.00	374,766.00	
T 1.625 09/30/26	480,000.00	446,078.40	
T 1.625 10/31/23	750,000.00	733,912.50	
T 1.625 11/15/50	720,000.00	475,027.20	
T 1.625 11/30/26	650,000.00	602,465.50	
T 1.75 01/31/29	540,000.00	487,539.00	
T 1.75 06/30/24	400,000.00	387,340.00	
T 1.75 07/31/24	400,000.00	386,968.00	
T 1.75 08/15/41	640,000.00	463,596.80	
T 1.75 11/15/29	330,000.00	296,973.60	
T 1.75 12/31/24	390,000.00	374,400.00	
T 1.75 12/31/26	300,000.00	279,222.00	
T 1.875 02/15/32	1,050,000.00	927,192.00	
T 1.875 02/15/41	410,000.00	307,049.00	
T 1.875 02/15/51	730,000.00	513,562.30	
T 1.875 02/28/27	200,000.00	186,710.00	
T 1.875 02/28/29	850,000.00	773,525.50	
T 1.875 06/30/26	750,000.00	705,960.00	
T 1.875 08/31/24	300,000.00	290,577.00	
T 1.875 11/15/51	670,000.00	470,514.20	
T 2 02/15/25	660,000.00	635,916.60	
T 2 02/15/50	470,000.00	343,283.30	
T 2 04/30/24	200,000.00	195,140.00	
T 2 05/31/24	500,000.00	487,070.00	
T 2 06/30/24	600,000.00	583,872.00	
T 2 08/15/25	600,000.00	573,276.00	
T 2 08/15/51	680,000.00	493,047.60	
T 2 11/15/26	490,000.00	460,825.40	
T 2 11/15/41	590,000.00	446,600.50	
T 2.125 03/31/24	280,000.00	273,960.40	
T 2.125 05/15/25	570,000.00	548,357.10	
T 2.125 05/31/26	320,000.00	304,112.00	
T 2.125 07/31/24	410,000.00	399,458.90	
T 2.25 01/31/24	460,000.00	451,913.20	

T 2.25 02/15/27	450,000.00	426,514.50	
T 2.25 02/15/52	440,000.00	339,244.40	
T 2.25 03/31/24	1,060,000.00	1,038,800.00	
T 2.25 03/31/26	420,000.00	401,490.60	
T 2.25 04/30/24	420,000.00	411,301.80	
T 2.25 05/15/41	270,000.00	215,006.40	
T 2.25 08/15/27	570,000.00	538,513.20	
T 2.25 08/15/46	250,000.00	190,437.50	
T 2.25 08/15/49	460,000.00	356,605.80	
T 2.25 10/31/24	580,000.00	564,409.60	
T 2.25 11/15/24	500,000.00	486,480.00	
T 2.25 11/15/27	570,000.00	537,019.80	
T 2.25 12/31/23	550,000.00	540,886.50	
T 2.25 12/31/24	500,000.00	485,270.00	
T 2.375 02/15/42	530,000.00	429,088.00	
T 2.375 03/31/29	290,000.00	271,512.50	
T 2.375 04/30/26	400,000.00	384,140.00	
T 2.375 05/15/27	840,000.00	799,108.80	
T 2.375 05/15/29	600,000.00	561,840.00	
T 2.375 05/15/51	590,000.00	469,510.20	
T 2.375 08/15/24	270,000.00	264,114.00	
T 2.375 11/15/49	480,000.00	382,872.00	
T 2.5 01/31/24	450,000.00	443,457.00	
T 2.5 01/31/25	400,000.00	390,028.00	
T 2.5 02/15/45	220,000.00	177,339.80	
T 2.5 02/15/46	150,000.00	120,357.00	
T 2.5 03/31/27	310,000.00	297,125.70	
T 2.5 04/30/24	570,000.00	560,287.20	
T 2.5 05/15/24	900,000.00	884,529.00	
T 2.5 05/15/46	230,000.00	184,430.10	
T 2.625 01/31/26	430,000.00	416,493.70	
T 2.625 02/15/29	520,000.00	495,196.00	
T 2.625 03/31/25	500,000.00	487,965.00	
T 2.625 07/31/29	270,000.00	256,805.10	
T 2.625 12/31/25	510,000.00	494,898.90	
T 2.75 02/15/28	420,000.00	404,951.40	
T 2.75 02/28/25	500,000.00	489,880.00	
T 2.75 04/30/27	290,000.00	280,844.70	
T 2.75 05/15/25	320,000.00	312,934.40	
T 2.75 05/31/29	430,000.00	411,806.70	
T 2.75 06/30/25	490,000.00	478,627.10	
T 2.75 07/31/27	350,000.00	338,772.00	
T 2.75 08/15/32	260,000.00	247,546.00	
T 2.75 08/15/42	150,000.00	128,718.00	

T 2.75 08/15/47	210,000.00	177,219.00	
T 2.75 08/31/25	270,000.00	263,449.80	
T 2.75 11/15/23	900,000.00	891,351.00	
T 2.75 11/15/42	440,000.00	376,679.60	
T 2.75 11/15/47	250,000.00	211,132.50	
T 2.875 04/30/25	200,000.00	196,108.00	
T 2.875 05/15/28	500,000.00	484,375.00	
T 2.875 05/15/32	1,000,000.00	962,460.00	
T 2.875 05/15/43	290,000.00	252,503.00	
T 2.875 05/15/49	410,000.00	361,533.90	
T 2.875 05/15/52	700,000.00	623,000.00	
T 2.875 05/31/25	600,000.00	588,186.00	
T 2.875 07/31/25	300,000.00	293,928.00	
T 2.875 08/15/28	660,000.00	638,569.80	
T 2.875 08/15/45	110,000.00	94,875.00	
T 2.875 11/15/46	340,000.00	293,301.00	
T 2.875 11/30/23	900,000.00	892,890.00	
T 2.875 11/30/25	390,000.00	381,466.80	
T 3 02/15/47	120,000.00	105,955.20	
T 3 02/15/48	400,000.00	355,372.00	
T 3 02/15/49	370,000.00	333,662.30	
T 3 05/15/42	290,000.00	260,478.00	
T 3 05/15/45	290,000.00	255,652.40	
T 3 05/15/47	300,000.00	265,125.00	
T 3 06/30/24	600,000.00	594,000.00	
T 3 07/15/25	1,080,000.00	1,062,104.40	
T 3 08/15/48	510,000.00	455,572.80	
T 3 08/15/52	170,000.00	155,628.20	
T 3 09/30/25	620,000.00	609,168.60	
T 3 11/15/44	220,000.00	194,132.40	
T 3 11/15/45	300,000.00	264,654.00	
T 3.125 02/15/42	150,000.00	137,812.50	
T 3.125 02/15/43	190,000.00	172,527.60	
T 3.125 05/15/48	420,000.00	383,510.40	
T 3.125 08/15/44	380,000.00	342,919.60	
T 3.125 11/15/28	380,000.00	372,932.00	
T 3.125 11/15/41	210,000.00	193,116.00	
T 3.25 05/15/42	250,000.00	233,730.00	
T 3.25 06/30/27	280,000.00	277,188.80	
T 3.25 06/30/29	830,000.00	820,305.60	
T 3.375 05/15/44	300,000.00	282,456.00	
T 3.375 11/15/48	450,000.00	432,490.50	
T 3.5 02/15/39	180,000.00	181,026.00	
T 3.625 02/15/44	270,000.00	264,492.00	

T 3.625 08/15/43	230,000.00	226,064.70	
T 3.875 08/15/40	340,000.00	352,416.80	
T 4.25 05/15/39	170,000.00	187,311.10	
T 4.25 11/15/40	140,000.00	152,238.80	
T 4.375 02/15/38	40,000.00	44,843.60	
T 4.375 05/15/40	140,000.00	155,421.00	
T 4.375 05/15/41	620,000.00	684,467.60	
T 4.375 11/15/39	150,000.00	167,238.00	
T 4.5 02/15/36	100,000.00	113,429.00	
T 4.5 08/15/39	120,000.00	136,050.00	
T 4.625 02/15/40	100,000.00	114,781.00	
T 5.25 11/15/28	200,000.00	219,514.00	
T 5.375 02/15/31	80,000.00	91,756.00	
US TREASURY N/B	630,000.00	598,890.60	
US TREASURY N/B	520,000.00	490,750.00	
アメリカ・ドル小計	105,850,000.00	96,208,537.40 (13,740,503,311)	
カナダ・ドル			
CAN 0.25 03/01/26	270,000.00	242,562.60	
CAN 0.25 04/01/24	460,000.00	436,935.60	
CAN 0.5 09/01/25	270,000.00	247,463.10	
CAN 0.5 12/01/30	340,000.00	275,148.40	
CAN 1 06/01/27	140,000.00	126,688.80	
CAN 1.25 03/01/25	250,000.00	236,462.50	
CAN 1.25 03/01/27	160,000.00	146,745.60	
CAN 1.25 06/01/30	380,000.00	331,090.20	
CAN 1.5 06/01/26	170,000.00	159,274.70	
CAN 1.5 06/01/31	350,000.00	306,131.00	
CAN 1.5 09/01/24	230,000.00	221,013.90	
CAN 1.5 12/01/31	400,000.00	347,672.00	
CAN 1.75 12/01/53	210,000.00	151,857.30	
CAN 2 06/01/28	60,000.00	56,382.60	
CAN 2 12/01/51	400,000.00	312,024.00	
CAN 2.25 03/01/24	140,000.00	137,267.20	
CAN 2.25 06/01/25	160,000.00	154,932.80	
CAN 2.25 06/01/29	150,000.00	142,101.00	
CAN 2.25 12/01/29	60,000.00	56,660.40	
CAN 2.5 06/01/24	440,000.00	432,080.00	
CAN 2.75 12/01/48	90,000.00	83,403.90	
CAN 3.5 12/01/45	90,000.00	94,420.80	
CAN 4 06/01/41	140,000.00	155,397.20	
CAN 5 06/01/37	100,000.00	120,623.00	
CAN 5.75 06/01/29	90,000.00	104,107.50	
CAN 5.75 06/01/33	30,000.00	36,942.00	
CANADA 2.75 12/01/64	50,000.00	45,259.00	

カナダ・ドル小計		5,630,000.00	5,160,647.10 (566,226,200)	
オーストラリア・ドル	ACGB 0.25 11/21/24	340,000.00	319,960.40	
	ACGB 0.25 11/21/25	140,000.00	127,666.00	
	ACGB 0.5 09/21/26	160,000.00	143,678.40	
	ACGB 1 11/21/31	280,000.00	224,490.00	
	ACGB 1 12/21/30	260,000.00	213,496.40	
	ACGB 1.25 05/21/32	170,000.00	138,067.20	
	ACGB 1.5 06/21/31	290,000.00	245,853.30	
	ACGB 1.75 06/21/51	190,000.00	121,415.70	
	ACGB 1.75 11/21/32	200,000.00	169,062.00	
	ACGB 2.25 05/21/28	190,000.00	179,527.20	
	ACGB 2.5 05/21/30	200,000.00	187,046.00	
	ACGB 2.75 04/21/24	130,000.00	129,634.70	
	ACGB 2.75 05/21/41	130,000.00	110,728.80	
	ACGB 2.75 06/21/35	120,000.00	108,409.20	
	ACGB 2.75 11/21/27	320,000.00	311,779.20	
	ACGB 2.75 11/21/28	110,000.00	106,322.70	
	ACGB 2.75 11/21/29	180,000.00	172,252.80	
	ACGB 3 03/21/47	140,000.00	120,929.20	
	ACGB 3 11/21/33	100,000.00	94,398.00	
	ACGB 3.25 04/21/25	180,000.00	180,579.60	
ACGB 3.25 04/21/29	130,000.00	128,936.60		
ACGB 3.25 06/21/39	110,000.00	102,127.30		
ACGB 3.75 04/21/37	120,000.00	119,727.60		
ACGB 4.25 04/21/26	170,000.00	176,092.80		
ACGB 4.5 04/21/33	180,000.00	194,547.60		
ACGB 4.75 04/21/27	160,000.00	170,225.60		
オーストラリア・ドル小計		4,700,000.00	4,296,954.30 (420,027,283)	
シンガポール・ドル	SIGB 1.875 03/01/50	180,000.00	138,780.00	
	SIGB 2 02/01/24	120,000.00	118,524.00	
	SIGB 2.125 06/01/26	500,000.00	486,250.00	
	SIGB 2.25 08/01/36	210,000.00	189,535.50	
	SIGB 2.375 06/01/25	100,000.00	98,630.00	
	SIGB 2.375 07/01/39	100,000.00	90,300.00	
	SIGB 2.625 05/01/28	230,000.00	225,699.00	
	SIGB 2.75 03/01/46	120,000.00	112,140.00	
	SIGB 2.75 04/01/42	100,000.00	94,298.00	
	SIGB 2.875 07/01/29	200,000.00	198,200.00	
	SIGB 2.875 09/01/30	320,000.00	316,000.00	
	SIGB 3 08/01/72	10,000.00	10,014.20	
	SIGB 3 09/01/24	230,000.00	230,414.00	
	SIGB 3.375 09/01/33	220,000.00	225,830.00	

シンガポール・ドル小計		2,640,000.00	2,534,614.70 (258,784,161)	
イギリス・ポンド	UK TSY GILT	190,000.00	133,589.00	
	UKT 0.125 01/30/26	130,000.00	118,072.50	
	UKT 0.125 01/31/24	290,000.00	278,324.60	
	UKT 0.125 01/31/28	120,000.00	103,054.80	
	UKT 0.25 01/31/25	160,000.00	149,416.00	
	UKT 0.25 07/31/31	200,000.00	155,870.00	
	UKT 0.375 10/22/26	100,000.00	89,800.00	
	UKT 0.375 10/22/30	160,000.00	129,672.00	
	UKT 0.5 01/31/29	170,000.00	144,889.30	
	UKT 0.5 10/22/61	140,000.00	54,994.80	
	UKT 0.625 06/07/25	130,000.00	122,116.80	
	UKT 0.625 07/31/35	180,000.00	127,719.00	
	UKT 0.625 10/22/50	80,000.00	39,425.60	
	UKT 0.875 01/31/46	110,000.00	63,309.40	
	UKT 0.875 07/31/33	120,000.00	93,958.80	
	UKT 0.875 10/22/29	100,000.00	86,405.00	
	UKT 1 01/31/32	150,000.00	123,636.00	
	UKT 1 04/22/24	220,000.00	212,957.80	
	UKT 1.125 10/22/73	90,000.00	44,342.10	
	UKT 1.25 07/22/27	270,000.00	248,724.00	
	UKT 1.25 07/31/51	120,000.00	71,400.00	
	UKT 1.25 10/22/41	200,000.00	137,028.00	
	UKT 1.5 07/22/26	140,000.00	132,533.80	
	UKT 1.5 07/22/47	150,000.00	99,436.50	
	UKT 1.5 07/31/53	90,000.00	56,520.90	
	UKT 1.625 10/22/28	110,000.00	101,792.90	
	UKT 1.625 10/22/54	100,000.00	64,648.00	
	UKT 1.625 10/22/71	130,000.00	79,482.00	
	UKT 1.75 01/22/49	110,000.00	76,714.00	
	UKT 1.75 07/22/57	140,000.00	93,578.80	
	UKT 1.75 09/07/37	200,000.00	159,424.00	
	UKT 2 09/07/25	110,000.00	107,058.60	
	UKT 2.25 09/07/23	30,000.00	29,767.80	
	UKT 2.5 07/22/65	140,000.00	115,472.00	
UKT 2.75 09/07/24	250,000.00	248,687.50		
UKT 3.25 01/22/44	180,000.00	170,904.60		
UKT 3.5 01/22/45	200,000.00	197,092.00		
UKT 3.5 07/22/68	170,000.00	179,292.20		
UKT 3.75 07/22/52	140,000.00	146,678.00		
UKT 4 01/22/60	110,000.00	125,101.90		
UKT 4.25 03/07/36	180,000.00	195,958.80		
UKT 4.25 06/07/32	210,000.00	230,017.20		

	UKT 4.25 09/07/39	130,000.00	142,179.70	
	UKT 4.25 12/07/27	130,000.00	137,456.80	
	UKT 4.25 12/07/40	140,000.00	153,638.80	
	UKT 4.25 12/07/46	160,000.00	176,860.80	
	UKT 4.25 12/07/49	90,000.00	100,953.90	
	UKT 4.25 12/07/55	170,000.00	197,310.50	
	UKT 4.5 09/07/34	150,000.00	167,688.00	
	UKT 4.5 12/07/42	210,000.00	238,843.50	
	UKT 4.75 12/07/30	160,000.00	180,200.00	
	UKT 4.75 12/07/38	110,000.00	127,471.30	
	UKT 5 03/07/25	80,000.00	83,649.60	
	UKT 6 12/07/28	100,000.00	116,605.00	
	イギリス・ボンド小計	7,950,000.00	7,161,724.90 (1,187,915,309)	
イスラエル・シュケル	ILGOV 1 03/31/30	190,000.00	164,272.10	
	ILGOV 1.3 04/30/32	120,000.00	102,854.40	
	ILGOV 1.5 05/31/37	260,000.00	207,095.20	
	ILGOV 1.5 11/30/23	480,000.00	473,419.20	
	ILGOV 1.75 08/31/25	230,000.00	222,318.00	
	ILGOV 2 03/31/27	140,000.00	134,106.00	
	ILGOV 2.25 09/28/28	230,000.00	220,358.40	
	ILGOV 3.75 03/31/24	120,000.00	121,605.60	
	ILGOV 3.75 03/31/47	290,000.00	303,003.60	
	ILGOV 5.5 01/31/42	90,000.00	117,712.80	
ILGOV 6.25 10/30/26	300,000.00	337,593.00		
	イスラエル・シュケル小計	2,450,000.00	2,404,338.30 (100,716,289)	
デンマーク・クローネ	DGB 0 11/15/24	460,000.00	445,592.80	
	DGB 0 11/15/31	690,000.00	574,287.00	
	DGB 0.25 11/15/52	480,000.00	280,401.60	
	DGB 0.5 11/15/27	830,000.00	776,672.50	
	DGB 0.5 11/15/29	670,000.00	607,415.30	
	DGB 1.5 11/15/23	400,000.00	401,820.00	
	DGB 1.75 11/15/25	480,000.00	482,390.40	
	DGB 4.5 11/15/39	1,100,000.00	1,465,805.00	
	デンマーク・クローネ小計	5,110,000.00	5,034,384.60 (97,364,998)	
ノルウェー・クローネ	NGB 1.25 09/17/31	390,000.00	327,085.20	
	NGB 1.375 08/19/30	550,000.00	475,739.00	
	NGB 1.5 02/19/26	390,000.00	366,814.50	
	NGB 1.75 02/17/27	420,000.00	392,490.00	
	NGB 1.75 03/13/25	810,000.00	779,268.60	
	NGB 1.75 09/06/29	500,000.00	451,110.00	
	NGB 2 04/26/28	360,000.00	335,278.80	

	NGB 2.125 05/18/32	240,000.00	216,216.00	
	NGB 3 03/14/24	500,000.00	498,450.00	
	ノルウェー・クローネ小計	4,160,000.00	3,842,452.10 (55,523,433)	
スウェーデン・クローナ	SGB 0.125 05/12/31	540,000.00	461,808.00	
	SGB 0.75 05/12/28	700,000.00	651,315.00	
	SGB 0.75 11/12/29	560,000.00	512,148.00	
	SGB 1 11/12/26	1,030,000.00	980,817.50	
	SGB 1.5 11/13/23	750,000.00	744,172.50	
	SGB 2.25 06/01/32	500,000.00	515,885.00	
	SGB 2.5 05/12/25	800,000.00	802,856.00	
	SGB 3.5 03/30/39	340,000.00	416,024.00	
	スウェーデン・クローナ小計	5,220,000.00	5,085,026.00 (68,597,002)	
メキシコ・ペソ	MBONO 10 11/20/36	320,000.00	348,684.80	
	MBONO 10 12/05/24	2,550,000.00	2,570,706.00	
	MBONO 5 03/06/25	1,300,000.00	1,169,181.00	
	MBONO 5.75 03/05/26	3,640,000.00	3,254,087.20	
	MBONO 7.5 06/03/27	3,300,000.00	3,112,626.00	
	MBONO 7.75 05/29/31	3,840,000.00	3,566,284.80	
	MBONO 7.75 11/13/42	2,000,000.00	1,765,620.00	
	MBONO 7.75 11/23/34	1,520,000.00	1,375,843.20	
	MBONO 8 09/05/24	2,980,000.00	2,889,348.40	
	MBONO 8 11/07/47	2,390,000.00	2,174,111.30	
	MBONO 8 12/07/23	2,160,000.00	2,109,304.80	
	MBONO 8.5 05/31/29	3,670,000.00	3,589,627.00	
	MBONO 8.5 11/18/38	2,700,000.00	2,581,470.00	
	メキシコ・ペソ小計	32,370,000.00	30,506,894.50 (219,344,571)	
オフショア・人民元	CGB 2.28 03/17/24	8,000,000.00	8,036,320.00	
	CGB 2.47 09/02/24	4,000,000.00	4,033,960.00	
	CGB 2.48 04/15/27	3,000,000.00	3,012,630.00	
	CGB 2.69 08/12/26	3,000,000.00	3,038,400.00	
	CGB 2.91 10/14/28	9,000,000.00	9,168,210.00	
	CGB 3.02 05/27/31	5,000,000.00	5,120,300.00	
	CGB 3.72 04/12/51	4,000,000.00	4,436,880.00	
	オフショア・人民元小計	36,000,000.00	36,846,700.00 (758,898,318)	
ポーランド・ズロチ	POLGB 0.25 10/25/26	680,000.00	534,378.00	
	POLGB 0.75 04/25/25	500,000.00	437,275.00	
	POLGB 1.25 10/25/30	450,000.00	314,910.00	
	POLGB 1.75 04/25/32	150,000.00	104,362.50	
	POLGB 2.25 10/25/24	1,310,000.00	1,206,195.60	
	POLGB 2.5 07/25/26	50,000.00	43,437.50	

	POLGB 2.5 07/25/27	170,000.00	143,259.00	
	POLGB 2.75 04/25/28	50,000.00	42,130.50	
	POLGB 2.75 10/25/29	480,000.00	389,880.00	
	POLGB 3.75 05/25/27	720,000.00	642,196.80	
	ポーランド・ズロチ小計	4,560,000.00	3,858,024.90 (118,291,287)	
ユーロ	BGB 0 10/22/27	105,000.00	95,446.05	
	BGB 0 10/22/31	140,000.00	114,786.00	
	BGB 0.1 06/22/30	120,000.00	103,524.00	
	BGB 0.2 10/22/23	80,000.00	79,089.60	
	BGB 0.35 06/22/32	170,000.00	140,567.90	
	BGB 0.4 06/22/40	90,000.00	60,354.90	
	BGB 0.5 10/22/24	180,000.00	176,626.80	
	BGB 0.65 06/22/71	30,000.00	13,785.00	
	BGB 0.8 06/22/25	170,000.00	166,659.50	
	BGB 0.8 06/22/27	130,000.00	124,125.30	
	BGB 0.8 06/22/28	160,000.00	150,627.20	
	BGB 0.9 06/22/29	170,000.00	158,518.20	
	BGB 1 06/22/26	210,000.00	205,090.20	
	BGB 1 06/22/31	160,000.00	145,664.00	
	BGB 1.25 04/22/33	100,000.00	90,182.00	
	BGB 1.4 06/22/53	170,000.00	120,572.50	
	BGB 1.45 06/22/37	60,000.00	51,120.00	
	BGB 1.6 06/22/47	100,000.00	79,287.00	
	BGB 1.7 06/22/50	100,000.00	79,193.00	
	BGB 1.9 06/22/38	90,000.00	81,059.40	
	BGB 2.15 06/22/66	110,000.00	94,726.50	
	BGB 2.6 06/22/24	170,000.00	173,622.70	
	BGB 3 06/22/34	80,000.00	84,055.20	
	BGB 3.75 06/22/45	90,000.00	104,482.80	
	BGB 4 03/28/32	80,000.00	92,090.40	
	BGB 4.25 03/28/41	180,000.00	217,600.20	
	BGB 4.5 03/28/26	100,000.00	109,819.00	
	BGB 5 03/28/35	170,000.00	214,490.70	
	BGB 5.5 03/28/28	160,000.00	190,867.20	
	BKO 0 09/15/23	70,000.00	69,361.60	
	BTPS	220,000.00	210,155.00	
	BTPS 0 01/30/24	240,000.00	233,025.60	
	BTPS 0 04/15/24	190,000.00	183,277.80	
	BTPS 0 08/01/26	240,000.00	214,010.40	
	BTPS 0 11/29/23	190,000.00	185,189.20	
	BTPS 0 12/15/24	60,000.00	56,734.20	
	BTPS 0.25 03/15/28	100,000.00	84,645.00	
	BTPS 0.35 02/01/25	170,000.00	161,452.40	

BTPS 0.45 02/15/29	290,000.00	240,004.00	
BTPS 0.5 02/01/26	170,000.00	157,267.00	
BTPS 0.5 07/15/28	250,000.00	212,400.00	
BTPS 0.6 08/01/31	290,000.00	220,333.30	
BTPS 0.65 10/15/23	160,000.00	157,603.20	
BTPS 0.85 01/15/27	240,000.00	218,947.20	
BTPS 0.9 04/01/31	210,000.00	166,332.60	
BTPS 0.95 03/01/37	190,000.00	126,840.20	
BTPS 0.95 06/01/32	220,000.00	168,203.20	
BTPS 0.95 08/01/30	180,000.00	146,588.40	
BTPS 0.95 09/15/27	210,000.00	188,548.50	
BTPS 0.95 12/01/31	200,000.00	155,294.00	
BTPS 1.1 04/01/27	50,000.00	45,695.50	
BTPS 1.25 12/01/26	270,000.00	251,661.60	
BTPS 1.35 04/01/30	240,000.00	204,472.80	
BTPS 1.45 03/01/36	190,000.00	139,980.60	
BTPS 1.45 05/15/25	200,000.00	193,706.00	
BTPS 1.45 11/15/24	250,000.00	244,820.00	
BTPS 1.5 04/30/45	130,000.00	81,035.50	
BTPS 1.5 06/01/25	430,000.00	417,241.90	
BTPS 1.6 06/01/26	230,000.00	219,700.60	
BTPS 1.65 03/01/32	240,000.00	198,784.80	
BTPS 1.65 12/01/30	210,000.00	179,543.70	
BTPS 1.7 09/01/51	140,000.00	86,038.40	
BTPS 1.8 03/01/41	280,000.00	197,271.20	
BTPS 1.85 05/15/24	330,000.00	327,346.80	
BTPS 2 02/01/28	320,000.00	300,716.80	
BTPS 2 12/01/25	220,000.00	214,766.20	
BTPS 2.05 08/01/27	280,000.00	266,011.20	
BTPS 2.1 07/15/26	250,000.00	242,582.50	
BTPS 2.15 03/01/72	50,000.00	31,831.50	
BTPS 2.15 09/01/52	70,000.00	46,688.60	
BTPS 2.2 06/01/27	180,000.00	172,807.20	
BTPS 2.25 09/01/36	170,000.00	138,119.90	
BTPS 2.45 09/01/33	150,000.00	129,471.00	
BTPS 2.45 09/01/50	150,000.00	109,434.00	
BTPS 2.45 10/01/23	160,000.00	160,681.60	
BTPS 2.5 11/15/25	240,000.00	237,768.00	
BTPS 2.5 12/01/24	130,000.00	130,154.70	
BTPS 2.7 03/01/47	150,000.00	118,581.00	
BTPS 2.8 03/01/67	90,000.00	68,084.10	
BTPS 2.8 06/15/29	130,000.00	124,272.20	
BTPS 2.8 12/01/28	200,000.00	193,760.00	
BTPS 2.95 09/01/38	100,000.00	86,866.00	

BTPS 3 08/01/29	200,000.00	194,162.00	
BTPS 3.1 03/01/40	120,000.00	105,014.40	
BTPS 3.25 03/01/38	70,000.00	62,869.80	
BTPS 3.25 09/01/46	180,000.00	157,554.00	
BTPS 3.35 03/01/35	130,000.00	120,903.90	
BTPS 3.45 03/01/48	180,000.00	161,827.20	
BTPS 3.5 03/01/30	240,000.00	239,647.20	
BTPS 3.75 09/01/24	350,000.00	359,271.50	
BTPS 3.85 09/01/49	140,000.00	133,681.80	
BTPS 4 02/01/37	250,000.00	249,752.50	
BTPS 4.5 03/01/24	70,000.00	72,331.70	
BTPS 4.5 03/01/26	310,000.00	327,604.90	
BTPS 4.75 09/01/28	140,000.00	150,420.20	
BTPS 4.75 09/01/44	170,000.00	185,388.40	
BTPS 5 03/01/25	250,000.00	264,682.50	
BTPS 5 08/01/34	220,000.00	239,927.60	
BTPS 5 08/01/39	220,000.00	245,269.20	
BTPS 5 09/01/40	180,000.00	199,931.40	
BTPS 5.25 11/01/29	250,000.00	278,912.50	
BTPS 5.75 02/01/33	270,000.00	311,102.10	
BTPS 6 05/01/31	250,000.00	292,635.00	
BTPS 6.5 11/01/27	190,000.00	220,700.20	
BTPS 9 11/01/23	170,000.00	182,993.10	
DBR 0 02/15/30	210,000.00	187,500.60	
DBR 0 02/15/31	290,000.00	253,970.40	
DBR 0 02/15/32	250,000.00	214,200.00	
DBR 0 05/15/35	200,000.00	159,340.00	
DBR 0 05/15/36	250,000.00	195,155.00	
DBR 0 08/15/26	320,000.00	303,702.40	
DBR 0 08/15/29	250,000.00	225,190.00	
DBR 0 08/15/30	430,000.00	380,132.90	
DBR 0 08/15/31	380,000.00	329,380.20	
DBR 0 08/15/50	280,000.00	170,559.20	
DBR 0 08/15/50	130,000.00	79,461.20	
DBR 0 08/15/52	170,000.00	99,324.20	
DBR 0 11/15/27	220,000.00	203,878.40	
DBR 0 11/15/28	220,000.00	200,690.60	
DBR 0.25 02/15/27	320,000.00	304,547.20	
DBR 0.25 02/15/29	250,000.00	230,825.00	
DBR 0.25 08/15/28	220,000.00	204,410.80	
DBR 0.5 02/15/25	230,000.00	225,860.00	
DBR 0.5 02/15/26	220,000.00	214,068.80	
DBR 0.5 02/15/28	230,000.00	218,187.20	
DBR 0.5 08/15/27	270,000.00	258,155.10	

DBR 1 05/15/38	120,000.00	105,849.60	
DBR 1 08/15/24	210,000.00	209,380.50	
DBR 1 08/15/25	300,000.00	297,747.00	
DBR 1.25 08/15/48	280,000.00	249,404.40	
DBR 1.5 05/15/24	390,000.00	392,605.20	
DBR 1.7 08/15/32	110,000.00	109,927.40	
DBR 1.75 02/15/24	530,000.00	535,792.90	
DBR 2.5 07/04/44	260,000.00	292,115.20	
DBR 2.5 08/15/46	300,000.00	342,042.00	
DBR 3.25 07/04/42	180,000.00	223,414.20	
DBR 4 01/04/37	260,000.00	330,548.40	
DBR 4.25 07/04/39	170,000.00	228,757.10	
DBR 4.75 07/04/28	170,000.00	200,146.10	
DBR 4.75 07/04/34	230,000.00	304,478.60	
DBR 4.75 07/04/40	220,000.00	316,390.80	
DBR 5.5 01/04/31	220,000.00	286,831.60	
DBR 5.625 01/04/28	310,000.00	374,715.60	
DBR 6.25 01/04/30	130,000.00	172,172.00	
DBR 6.5 07/04/27	160,000.00	196,851.20	
FRANCE O.A.T.	250,000.00	150,087.50	
FRTR 0 02/25/24	300,000.00	294,921.00	
FRTR 0 02/25/26	540,000.00	511,018.20	
FRTR 0 02/25/27	350,000.00	323,893.50	
FRTR 0 03/25/24	410,000.00	402,193.60	
FRTR 0 03/25/25	510,000.00	490,507.80	
FRTR 0 05/25/32	310,000.00	250,752.80	
FRTR 0 11/25/29	400,000.00	348,004.00	
FRTR 0 11/25/30	430,000.00	364,210.00	
FRTR 0 11/25/31	510,000.00	420,010.50	
FRTR 0.25 11/25/26	360,000.00	338,893.20	
FRTR 0.5 05/25/25	490,000.00	476,270.20	
FRTR 0.5 05/25/26	480,000.00	460,372.80	
FRTR 0.5 05/25/29	570,000.00	519,572.10	
FRTR 0.5 05/25/40	310,000.00	217,669.60	
FRTR 0.5 05/25/72	80,000.00	35,299.20	
FRTR 0.5 06/25/44	120,000.00	78,801.60	
FRTR 0.75 05/25/28	710,000.00	667,258.00	
FRTR 0.75 05/25/52	280,000.00	172,312.00	
FRTR 0.75 11/25/28	500,000.00	466,835.00	
FRTR 1 05/25/27	450,000.00	434,407.50	
FRTR 1 11/25/25	450,000.00	441,828.00	
FRTR 1.25 05/25/34	340,000.00	299,376.80	
FRTR 1.25 05/25/36	390,000.00	332,638.80	
FRTR 1.5 05/25/31	480,000.00	460,622.40	

FRTR 1.5 05/25/50	340,000.00	264,336.40	
FRTR 1.75 05/25/66	120,000.00	94,887.60	
FRTR 1.75 06/25/39	300,000.00	268,335.00	
FRTR 1.75 11/25/24	600,000.00	603,594.00	
FRTR 2 05/25/48	310,000.00	273,097.60	
FRTR 2.25 05/25/24	350,000.00	355,544.00	
FRTR 2.5 05/25/30	660,000.00	686,901.60	
FRTR 2.75 10/25/27	470,000.00	491,615.30	
FRTR 3.25 05/25/45	280,000.00	308,887.60	
FRTR 3.5 04/25/26	420,000.00	447,384.00	
FRTR 4 04/25/55	200,000.00	257,042.00	
FRTR 4 04/25/60	170,000.00	225,073.20	
FRTR 4 10/25/38	270,000.00	320,365.80	
FRTR 4.25 10/25/23	340,000.00	351,492.00	
FRTR 4.5 04/25/41	350,000.00	446,218.50	
FRTR 4.75 04/25/35	300,000.00	374,148.00	
FRTR 5.5 04/25/29	340,000.00	414,827.20	
FRTR 5.75 10/25/32	440,000.00	578,661.60	
FRTR 6 10/25/25	180,000.00	204,139.80	
IRISH 0 10/18/31	100,000.00	82,329.00	
IRISH 0.2 05/15/27	60,000.00	55,783.20	
IRISH 0.2 10/18/30	40,000.00	34,447.60	
IRISH 0.35 10/18/32	80,000.00	66,081.60	
IRISH 0.4 05/15/35	40,000.00	31,197.20	
IRISH 0.9 05/15/28	80,000.00	75,697.60	
IRISH 1 05/15/26	120,000.00	117,370.80	
IRISH 1.1 05/15/29	100,000.00	94,585.00	
IRISH 1.3 05/15/33	50,000.00	45,248.00	
IRISH 1.35 03/18/31	60,000.00	56,858.40	
IRISH 1.5 05/15/50	70,000.00	53,907.00	
IRISH 1.7 05/15/37	70,000.00	63,032.90	
IRISH 2 02/18/45	100,000.00	89,239.00	
IRISH 2.4 05/15/30	100,000.00	103,065.00	
IRISH 3.4 03/18/24	80,000.00	82,484.00	
IRISH 5.4 03/13/25	100,000.00	109,515.00	
IRISH GOVT	50,000.00	34,791.50	
NETHER 0 01/15/24	140,000.00	137,795.00	
NETHER 0 01/15/26	60,000.00	57,015.60	
NETHER 0 01/15/27	150,000.00	139,851.00	
NETHER 0 01/15/29	110,000.00	98,122.20	
NETHER 0 01/15/38	80,000.00	57,590.40	
NETHER 0 01/15/52	130,000.00	70,122.00	
NETHER 0 07/15/30	120,000.00	104,198.40	
NETHER 0 07/15/31	160,000.00	135,793.60	

NETHER 0.25 07/15/25	210,000.00	202,813.80	
NETHER 0.25 07/15/29	130,000.00	117,133.90	
NETHER 0.5 01/15/40	160,000.00	122,433.60	
NETHER 0.5 07/15/26	160,000.00	153,560.00	
NETHER 0.5 07/15/32	100,000.00	86,684.00	
NETHER 0.75 07/15/27	170,000.00	162,970.50	
NETHER 0.75 07/15/28	140,000.00	132,465.20	
NETHER 2 07/15/24	170,000.00	172,247.40	
NETHER 2.5 01/15/33	140,000.00	146,178.20	
NETHER 2.75 01/15/47	200,000.00	224,142.00	
NETHER 3.75 01/15/42	160,000.00	200,644.80	
NETHER 4 01/15/37	180,000.00	220,357.80	
NETHER 5.5 01/15/28	140,000.00	166,912.20	
OBL 0 04/05/24	410,000.00	403,226.80	
OBL 0 04/10/26	210,000.00	200,453.40	
OBL 0 04/11/25	190,000.00	183,910.50	
OBL 0 04/16/27	150,000.00	140,383.50	
OBL 0 10/09/26	170,000.00	160,508.90	
OBL 0 10/10/25	310,000.00	298,669.50	
OBL 0 10/13/23	200,000.00	197,880.00	
OBL 0 10/18/24	310,000.00	302,181.80	
RAGB 0 02/20/30	120,000.00	102,652.80	
RAGB 0 02/20/31	100,000.00	83,219.00	
RAGB 0 04/20/25	90,000.00	86,343.30	
RAGB 0 07/15/24	160,000.00	156,166.40	
RAGB 0 10/20/28	30,000.00	26,542.80	
RAGB 0 10/20/40	50,000.00	31,548.50	
RAGB 0.25 10/20/36	110,000.00	80,884.10	
RAGB 0.5 02/20/29	110,000.00	99,902.00	
RAGB 0.5 04/20/27	150,000.00	141,715.50	
RAGB 0.7 04/20/71	50,000.00	25,083.00	
RAGB 0.75 02/20/28	130,000.00	122,084.30	
RAGB 0.75 03/20/51	80,000.00	51,736.00	
RAGB 0.75 10/20/26	150,000.00	144,402.00	
RAGB 0.9 02/20/32	100,000.00	88,155.00	
RAGB 1.2 10/20/25	100,000.00	98,833.00	
RAGB 1.5 02/20/47	70,000.00	57,712.90	
RAGB 1.5 11/02/86	100,000.00	67,978.00	
RAGB 1.65 10/21/24	80,000.00	80,431.20	
RAGB 1.75 10/20/23	80,000.00	80,611.20	
RAGB 1.85 05/23/49	50,000.00	43,681.50	
RAGB 2.4 05/23/34	60,000.00	59,923.80	
RAGB 3.15 06/20/44	50,000.00	55,834.50	
RAGB 3.8 01/26/62	50,000.00	64,872.00	

RAGB 4.15 03/15/37	140,000.00	168,525.00	
RAGB 4.85 03/15/26	100,000.00	111,211.00	
RAGB 6.25 07/15/27	80,000.00	96,622.40	
RFGB 0 09/15/23	30,000.00	29,648.10	
RFGB 0 09/15/24	60,000.00	58,455.00	
RFGB 0 09/15/26	40,000.00	37,377.20	
RFGB 0 09/15/30	70,000.00	59,413.90	
RFGB 0.125 04/15/36	40,000.00	29,474.80	
RFGB 0.125 04/15/52	20,000.00	10,456.00	
RFGB 0.125 09/15/31	40,000.00	33,423.20	
RFGB 0.25 09/15/40	50,000.00	33,774.50	
RFGB 0.5 04/15/26	70,000.00	67,258.10	
RFGB 0.5 04/15/43	30,000.00	20,321.10	
RFGB 0.5 09/15/27	40,000.00	37,527.20	
RFGB 0.5 09/15/28	80,000.00	73,616.80	
RFGB 0.5 09/15/29	50,000.00	45,136.50	
RFGB 0.75 04/15/31	60,000.00	53,668.20	
RFGB 0.875 09/15/25	100,000.00	98,091.00	
RFGB 1.125 04/15/34	50,000.00	43,775.00	
RFGB 1.375 04/15/47	50,000.00	40,595.50	
RFGB 1.5 09/15/32	50,000.00	46,624.50	
RFGB 2.625 07/04/42	60,000.00	60,828.60	
RFGB 2.75 07/04/28	100,000.00	104,866.00	
SPGB 0 01/31/25	290,000.00	278,397.10	
SPGB 0 01/31/26	210,000.00	196,652.40	
SPGB 0 01/31/27	210,000.00	191,490.60	
SPGB 0 01/31/28	200,000.00	177,694.00	
SPGB 0 05/31/24	230,000.00	224,164.90	
SPGB 0 05/31/25	210,000.00	199,619.70	
SPGB 0.1 04/30/31	270,000.00	218,033.10	
SPGB 0.25 07/30/24	180,000.00	175,559.40	
SPGB 0.5 04/30/30	180,000.00	155,647.80	
SPGB 0.5 10/31/31	200,000.00	165,000.00	
SPGB 0.6 10/31/29	220,000.00	194,337.00	
SPGB 0.7 04/30/32	150,000.00	124,092.00	
SPGB 0.8 07/30/27	240,000.00	225,312.00	
SPGB 0.85 07/30/37	120,000.00	87,235.20	
SPGB 1 07/30/42	100,000.00	68,156.00	
SPGB 1 10/31/50	190,000.00	111,875.80	
SPGB 1.2 10/31/40	230,000.00	166,317.60	
SPGB 1.25 10/31/30	240,000.00	217,495.20	
SPGB 1.3 10/31/26	250,000.00	243,422.50	
SPGB 1.4 04/30/28	280,000.00	268,072.00	
SPGB 1.4 07/30/28	180,000.00	171,516.60	

SPGB 1.45 04/30/29	230,000.00	217,683.50	
SPGB 1.45 10/31/27	180,000.00	173,890.80	
SPGB 1.45 10/31/71	70,000.00	36,775.20	
SPGB 1.5 04/30/27	190,000.00	185,079.00	
SPGB 1.6 04/30/25	200,000.00	199,278.00	
SPGB 1.85 07/30/35	200,000.00	175,712.00	
SPGB 1.9 10/31/52	100,000.00	72,276.00	
SPGB 1.95 04/30/26	390,000.00	389,847.90	
SPGB 1.95 07/30/30	300,000.00	288,237.00	
SPGB 2.15 10/31/25	160,000.00	161,659.20	
SPGB 2.35 07/30/33	160,000.00	152,635.20	
SPGB 2.55 10/31/32	110,000.00	107,027.80	
SPGB 2.7 10/31/48	160,000.00	145,131.20	
SPGB 2.75 10/31/24	230,000.00	235,529.20	
SPGB 2.9 10/31/46	150,000.00	142,473.00	
SPGB 3.45 07/30/66	150,000.00	147,489.00	
SPGB 3.8 04/30/24	80,000.00	82,937.60	
SPGB 4.2 01/31/37	200,000.00	226,848.00	
SPGB 4.4 10/31/23	300,000.00	310,245.00	
SPGB 4.65 07/30/25	140,000.00	151,429.60	
SPGB 4.7 07/30/41	200,000.00	243,522.00	
SPGB 4.8 01/31/24	140,000.00	146,564.60	
SPGB 4.9 07/30/40	180,000.00	223,165.80	
SPGB 5.15 10/31/28	250,000.00	290,367.50	
SPGB 5.15 10/31/44	160,000.00	209,510.40	
SPGB 5.75 07/30/32	220,000.00	278,308.80	
SPGB 5.9 07/30/26	110,000.00	126,370.20	
SPGB 6 01/31/29	260,000.00	317,353.40	
ユーロ小計	64,235,000.00	61,643,060.35 (8,866,121,370)	
国債証券合計		26,458,313,532 (26,458,313,532)	
合計		26,458,313,532 (26,458,313,532)	

(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	217銘柄	52.8%	51.9%
カナダ・ドル	国債証券	27銘柄	2.2%	2.1%
オーストラリア・ドル	国債証券	26銘柄	1.6%	1.6%
シンガポール・ドル	国債証券	14銘柄	1.0%	1.0%
イギリス・ポンド	国債証券	54銘柄	4.6%	4.5%
イスラエル・シケル	国債証券	11銘柄	0.4%	0.4%
デンマーク・クローネ	国債証券	8銘柄	0.4%	0.4%
ノルウェー・クローネ	国債証券	9銘柄	0.2%	0.2%

スウェーデン・クローナ	国債証券	8銘柄	0.3%	0.3%
メキシコ・ペソ	国債証券	13銘柄	0.8%	0.8%
オフショア・人民元	国債証券	7銘柄	2.9%	2.9%
ポーランド・ズロチ	国債証券	10銘柄	0.5%	0.4%
ユーロ	国債証券	330銘柄	34.1%	33.5%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

外国債券パッシブ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2021年9月10日現在)	(2022年9月12日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	116,030,775	216,174,427
金銭信託	156,415,906	51,618,064
コール・ローン	303,057,345	1,450,811,286
国債証券	158,834,336,056	156,284,273,534
派生商品評価勘定	-	135,775
未収利息	836,019,849	895,513,359
前払費用	26,225,070	52,019,452
流動資産合計	160,272,085,001	158,950,545,897
資産合計	160,272,085,001	158,950,545,897
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	551,738
未払金	-	804,434,374
未払解約金	40,798,941	235,539,148
未払利息	668	-
その他未払費用	10,504	2,737
流動負債合計	40,810,113	1,040,527,997
負債合計	40,810,113	1,040,527,997
純資産の部		
元本等		
元本	81,240,238,352	76,795,410,154
剰余金		
剰余金又は欠損金()	78,991,036,536	81,114,607,746
元本等合計	160,231,274,888	157,910,017,900
純資産合計	160,231,274,888	157,910,017,900
負債純資産合計	160,272,085,001	158,950,545,897

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2021年9月11日 至 2022年9月12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	（2021年9月10日現在）	（2022年9月12日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	81,240,238,352口	76,795,410,154口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.9723円 （1万口当たりの純資産額19,723円）	1口当たり純資産額 2.0562円 （1万口当たりの純資産額20,562円）

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年9月11日 至 2022年9月12日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券</p> <p>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p>

	<p>2) デリバティブ取引</p> <p>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
<p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項 目	(2022年9月12日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券（国債証券）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p>

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年9月10日現在)

該当事項はありません。

(2022年9月12日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	419,826,935	-	419,385,707	441,228
	カナダ・ドル	19,096,753	-	19,096,996	243
	シンガポール・ドル	9,090,504	-	9,085,355	5,149
	イギリス・ポンド	40,962,831	-	41,031,426	68,595
	デンマーク・クローネ	3,622,456	-	3,620,897	1,559
	オフショア・人民元	43,012,952	-	43,078,842	65,890
	ユーロ	277,328,813	-	277,225,882	102,931
	小計	812,941,244	-	812,525,105	416,139
	売建				
	デンマーク・クローネ	2,356	-	2,356	-
	ユーロ	1,229,058	-	1,228,882	176
小計	1,231,414	-	1,231,238	176	
合計		814,172,658	-	813,756,343	415,963

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2021年9月11日 至 2022年9月12日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2021年9月10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	86,651,796,345円
同期中における追加設定元本額	8,899,935,389円
同期中における一部解約元本額	14,311,493,382円
2021年9月10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	24,390,596,375円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	761,022,261円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,095,214,066円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,103,670,901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)	112,000,859円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	7,016,735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)	30,488,397円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	99,555,827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)	206,938,212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)	138,581,301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)	238,457,653円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	24,289,186円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	60,371,045円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	81,937,511円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	56,724,347円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	16,102,594円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	58,265,762円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	42,748,577円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	104,100,384円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	27,675,437円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	14,002,349円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	101,717,793円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	199,947,568円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	12,052,227円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	32,752,949円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	22,100,213円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,172,899円
日興F W S・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	504,541円
三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド	3,009,093円

SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	2,310,597,405円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	45,899,893円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	7,801,603,636円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	4,694,680,423円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	10,840,471,131円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	35,901,694円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	95,696,295円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	724,470,054円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	117,631,749円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,068,564,548円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,431,714,372円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,598,287,873円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	5,023,496,861円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	622,437円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	8,421,225,670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)	341,011,119円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	151,272,369円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	85,197,734円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	34,472,321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>	101,951,512円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	438,469,208円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	112,773,770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>	5,263,229円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,073,075,999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>	684,038,861円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	999,642,200円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	1,485,462,252円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	451,612,674円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	16,664,143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>	102,290,689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>	251,915,932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>	274,112,391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>	324,022,967円
合計	81,240,238,352円

(2022年9月12日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	81,240,238,352円
同期中における追加設定元本額	11,527,343,152円
同期中における一部解約元本額	15,972,171,350円
2022年9月12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	25,304,562,579円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	828,158,382円

三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,156,635,138円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,175,001,572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)	152,526,311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)	6,250,590円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	28,036,019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)	92,655,686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)	248,930,241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)	175,779,350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)	284,649,148円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	23,205,142円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	48,841,238円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	71,389,406円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	49,801,190円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	21,503,378円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	77,033,842円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	57,841,285円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	150,738,817円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	45,415,312円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	22,253,366円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	158,279,290円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	573,738,813円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	31,891,251円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	90,183,578円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	58,720,361円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,996,394円
日興F W S・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	392,532,958円
三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド	16,444,846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>	3,751,614,393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>	33,601,811円
S M A M・バランスファンドV A 2 5<適格機関投資家専用>	6,132,655,891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>	4,104,311,686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>	9,462,762,482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>	30,929,407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>	79,724,138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>	658,062,897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>	111,106,124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>	965,401,491円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0<適格機関投資家専用>	1,298,450,320円
S M A M・バランスファンドV A 4 0<適格機関投資家専用>	1,386,224,062円
S M A M・バランスファンドV A 3 5<適格機関投資家専用>	4,291,532,671円
S M A M・バランスV A株40T<適格機関投資家限定>	604,716円
S M A M・外国債券パッシブファンドV A<適格機関投資家限定>	7,287,566,777円
三井住友・外国債券インデックスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	314,944,759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>	128,907,845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>	70,531,533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>	31,256,873円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A<適格機関投資家専用>	11,647,293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>	84,871,500円

SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	380,180,554円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	90,192,358円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	38,868,189円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,501,058円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	925,852,704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>	568,480,944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>	801,852,282円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	471,632,336円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	292,927,346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>	127,771,330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>	98,401,799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>	126,093,242円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	284,951,860円
合 計	76,795,410,154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

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	7,335,405.00	
		T 0.125 10/15/23	5,700,000.00	5,490,012.00	
		T 0.25 05/31/25	4,400,000.00	4,020,148.00	
		T 0.25 06/30/25	2,900,000.00	2,643,756.00	
		T 0.25 07/31/25	300,000.00	272,577.00	
		T 0.25 09/30/25	2,000,000.00	1,807,640.00	
		T 0.25 11/15/23	3,000,000.00	2,887,500.00	
		T 0.375 04/30/25	3,000,000.00	2,758,590.00	
		T 0.375 07/31/27	2,500,000.00	2,157,025.00	
		T 0.375 09/15/24	3,000,000.00	2,815,290.00	
		T 0.375 09/30/27	4,800,000.00	4,117,104.00	
		T 0.375 11/30/25	2,000,000.00	1,804,600.00	
		T 0.375 12/31/25	3,000,000.00	2,700,570.00	
		T 0.5 03/31/25	600,000.00	555,000.00	
		T 0.5 04/30/27	1,200,000.00	1,048,500.00	
		T 0.5 05/31/27	2,500,000.00	2,178,600.00	
		T 0.5 06/30/27	4,000,000.00	3,479,680.00	
		T 0.625 03/31/27	2,400,000.00	2,114,616.00	
		T 0.625 05/15/30	7,500,000.00	6,124,200.00	
		T 0.625 07/31/26	3,600,000.00	3,219,732.00	
T 0.625 08/15/30	7,000,000.00	5,684,210.00			
T 0.625 10/15/24	4,400,000.00	4,140,796.00			
T 0.625 11/30/27	2,100,000.00	1,816,080.00			

T 0.625 12/31/27	7,200,000.00	6,212,232.00	
T 0.75 01/31/28	5,900,000.00	5,118,427.00	
T 0.75 11/15/24	5,200,000.00	4,893,252.00	
T 0.875 01/31/24	2,000,000.00	1,927,020.00	
T 0.875 11/15/30	7,000,000.00	5,790,260.00	
T 1 07/31/28	5,900,000.00	5,130,640.00	
T 1 12/15/24	4,500,000.00	4,249,305.00	
T 1.125 01/15/25	2,000,000.00	1,889,840.00	
T 1.125 02/15/31	8,500,000.00	7,149,945.00	
T 1.125 02/28/25	1,500,000.00	1,413,045.00	
T 1.125 02/28/27	2,000,000.00	1,806,640.00	
T 1.125 05/15/40	2,000,000.00	1,329,200.00	
T 1.125 08/15/40	3,200,000.00	2,103,232.00	
T 1.125 08/31/28	3,500,000.00	3,060,435.00	
T 1.25 05/15/50	5,100,000.00	3,035,265.00	
T 1.25 06/30/28	3,000,000.00	2,649,600.00	
T 1.25 08/15/31	5,200,000.00	4,372,056.00	
T 1.25 09/30/28	4,500,000.00	3,957,345.00	
T 1.25 11/30/26	4,200,000.00	3,827,376.00	
T 1.25 12/31/26	2,300,000.00	2,093,000.00	
T 1.375 01/31/25	1,900,000.00	1,804,107.00	
T 1.375 08/15/50	4,500,000.00	2,770,650.00	
T 1.375 08/31/23	2,500,000.00	2,447,250.00	
T 1.375 08/31/26	7,100,000.00	6,536,970.00	
T 1.375 09/30/23	3,000,000.00	2,932,500.00	
T 1.375 10/31/28	6,000,000.00	5,310,420.00	
T 1.375 11/15/31	4,900,000.00	4,146,233.00	
T 1.375 11/15/40	2,000,000.00	1,372,500.00	
T 1.375 12/31/28	2,500,000.00	2,208,975.00	
T 1.5 01/31/27	4,400,000.00	4,042,632.00	
T 1.5 02/15/25	3,000,000.00	2,853,510.00	
T 1.5 02/15/30	2,100,000.00	1,845,858.00	
T 1.5 09/30/24	3,000,000.00	2,878,590.00	
T 1.5 10/31/24	5,500,000.00	5,267,955.00	
T 1.5 11/30/24	800,000.00	764,872.00	
T 1.5 11/30/28	2,300,000.00	2,047,805.00	
T 1.625 02/15/26	2,900,000.00	2,716,691.00	
T 1.625 05/15/26	14,950,000.00	13,958,964.50	
T 1.625 05/15/31	5,500,000.00	4,802,160.00	
T 1.625 08/15/29	450,000.00	401,535.00	
T 1.625 09/30/26	3,900,000.00	3,624,387.00	
T 1.625 10/31/23	3,000,000.00	2,935,650.00	
T 1.625 11/15/50	3,200,000.00	2,111,232.00	
T 1.625 11/30/26	200,000.00	185,374.00	

T 1.75 01/31/29	4,300,000.00	3,882,255.00	
T 1.75 03/15/25	1,500,000.00	1,433,835.00	
T 1.75 06/30/24	6,200,000.00	6,003,770.00	
T 1.75 07/31/24	850,000.00	822,307.00	
T 1.75 08/15/41	2,900,000.00	2,100,673.00	
T 1.75 11/15/29	2,000,000.00	1,799,840.00	
T 1.75 12/31/24	4,000,000.00	3,840,000.00	
T 1.75 12/31/26	3,500,000.00	3,257,590.00	
T 1.875 02/15/32	5,300,000.00	4,680,112.00	
T 1.875 02/15/41	2,800,000.00	2,096,920.00	
T 1.875 02/15/51	5,800,000.00	4,080,358.00	
T 1.875 02/28/27	3,400,000.00	3,174,070.00	
T 1.875 02/28/29	2,800,000.00	2,548,084.00	
T 1.875 08/31/24	3,800,000.00	3,680,642.00	
T 1.875 11/15/51	1,300,000.00	912,938.00	
T 2 02/15/25	3,500,000.00	3,372,285.00	
T 2 02/15/50	2,800,000.00	2,045,092.00	
T 2 04/30/24	2,000,000.00	1,951,400.00	
T 2 05/31/24	3,300,000.00	3,214,662.00	
T 2 06/30/24	4,100,000.00	3,989,792.00	
T 2 08/15/25	3,300,000.00	3,153,018.00	
T 2 08/15/51	2,900,000.00	2,102,703.00	
T 2 11/15/26	5,000,000.00	4,702,300.00	
T 2 11/15/41	3,800,000.00	2,876,410.00	
T 2.125 02/29/24	2,000,000.00	1,959,060.00	
T 2.125 03/31/24	6,500,000.00	6,359,795.00	
T 2.125 05/15/25	600,000.00	577,218.00	
T 2.125 07/31/24	3,500,000.00	3,410,015.00	
T 2.125 09/30/24	4,000,000.00	3,888,120.00	
T 2.125 11/30/23	3,100,000.00	3,047,920.00	
T 2.125 11/30/24	2,600,000.00	2,519,764.00	
T 2.25 01/31/24	2,200,000.00	2,161,324.00	
T 2.25 02/15/27	4,400,000.00	4,170,364.00	
T 2.25 02/15/52	1,700,000.00	1,310,717.00	
T 2.25 03/31/26	13,300,000.00	12,713,869.00	
T 2.25 04/30/24	3,800,000.00	3,721,302.00	
T 2.25 05/15/41	3,000,000.00	2,388,960.00	
T 2.25 08/15/27	4,200,000.00	3,967,992.00	
T 2.25 08/15/46	2,450,000.00	1,866,287.50	
T 2.25 08/15/49	3,500,000.00	2,713,305.00	
T 2.25 10/31/24	800,000.00	778,496.00	
T 2.25 11/15/24	5,100,000.00	4,962,096.00	
T 2.25 11/15/25	4,000,000.00	3,837,160.00	
T 2.25 11/15/27	4,400,000.00	4,145,416.00	

T 2.25 12/31/23	3,000,000.00	2,950,290.00	
T 2.25 12/31/24	3,900,000.00	3,785,106.00	
T 2.375 02/15/42	2,800,000.00	2,266,880.00	
T 2.375 02/29/24	3,700,000.00	3,637,248.00	
T 2.375 03/31/29	2,800,000.00	2,621,500.00	
T 2.375 05/15/27	3,000,000.00	2,853,960.00	
T 2.375 05/15/29	2,400,000.00	2,247,360.00	
T 2.375 05/15/51	1,400,000.00	1,114,092.00	
T 2.375 08/15/24	5,600,000.00	5,477,920.00	
T 2.375 11/15/49	1,900,000.00	1,515,535.00	
T 2.5 01/31/25	3,400,000.00	3,315,238.00	
T 2.5 02/15/45	3,600,000.00	2,901,924.00	
T 2.5 02/15/46	2,900,000.00	2,326,902.00	
T 2.5 02/28/26	2,100,000.00	2,025,261.00	
T 2.5 03/31/27	3,000,000.00	2,875,410.00	
T 2.5 05/15/24	5,700,000.00	5,602,017.00	
T 2.5 05/15/46	3,600,000.00	2,886,732.00	
T 2.625 01/31/26	2,700,000.00	2,615,193.00	
T 2.625 02/15/29	1,800,000.00	1,714,140.00	
T 2.625 03/31/25	1,000,000.00	975,930.00	
T 2.625 04/15/25	2,500,000.00	2,438,850.00	
T 2.625 05/31/27	3,000,000.00	2,890,410.00	
T 2.625 07/31/29	3,500,000.00	3,328,955.00	
T 2.625 12/31/23	1,900,000.00	1,877,732.00	
T 2.625 12/31/25	1,400,000.00	1,358,546.00	
T 2.75 02/15/24	5,100,000.00	5,041,401.00	
T 2.75 02/15/28	4,800,000.00	4,628,016.00	
T 2.75 02/28/25	2,000,000.00	1,959,520.00	
T 2.75 04/30/27	2,700,000.00	2,614,761.00	
T 2.75 05/15/25	3,000,000.00	2,933,760.00	
T 2.75 05/31/29	1,400,000.00	1,340,766.00	
T 2.75 06/30/25	900,000.00	879,111.00	
T 2.75 08/15/32	500,000.00	476,050.00	
T 2.75 08/15/42	2,000,000.00	1,716,240.00	
T 2.75 08/15/47	3,300,000.00	2,784,870.00	
T 2.75 08/31/23	3,800,000.00	3,768,650.00	
T 2.75 08/31/25	2,100,000.00	2,049,054.00	
T 2.75 11/15/23	4,200,000.00	4,159,638.00	
T 2.75 11/15/42	300,000.00	256,827.00	
T 2.75 11/15/47	1,500,000.00	1,266,795.00	
T 2.875 04/30/25	400,000.00	392,216.00	
T 2.875 04/30/29	3,500,000.00	3,378,585.00	
T 2.875 05/15/28	9,000,000.00	8,718,750.00	
T 2.875 05/15/32	5,700,000.00	5,486,022.00	

T 2.875 05/15/43	2,400,000.00	2,089,680.00	
T 2.875 05/15/49	1,400,000.00	1,234,506.00	
T 2.875 05/15/52	1,400,000.00	1,246,000.00	
T 2.875 05/31/25	3,100,000.00	3,038,961.00	
T 2.875 06/15/25	2,000,000.00	1,961,080.00	
T 2.875 08/15/28	4,500,000.00	4,353,885.00	
T 2.875 08/15/45	3,300,000.00	2,846,250.00	
T 2.875 10/31/23	1,000,000.00	992,180.00	
T 2.875 11/15/46	800,000.00	690,120.00	
T 2.875 11/30/23	2,000,000.00	1,984,200.00	
T 2.875 11/30/25	2,500,000.00	2,445,300.00	
T 3 02/15/47	2,500,000.00	2,207,400.00	
T 3 02/15/48	2,400,000.00	2,132,232.00	
T 3 02/15/49	3,300,000.00	2,975,907.00	
T 3 05/15/42	800,000.00	718,560.00	
T 3 05/15/45	3,000,000.00	2,644,680.00	
T 3 05/15/47	1,800,000.00	1,590,750.00	
T 3 08/15/48	900,000.00	803,952.00	
T 3 09/30/25	1,000,000.00	982,530.00	
T 3 10/31/25	3,600,000.00	3,535,452.00	
T 3 11/15/44	3,500,000.00	3,088,470.00	
T 3 11/15/45	2,700,000.00	2,381,886.00	
T 3.125 02/15/42	1,000,000.00	918,750.00	
T 3.125 02/15/43	2,300,000.00	2,088,492.00	
T 3.125 05/15/48	2,400,000.00	2,191,488.00	
T 3.125 08/15/25	3,000,000.00	2,959,980.00	
T 3.125 08/15/44	2,300,000.00	2,075,566.00	
T 3.125 11/15/28	2,900,000.00	2,846,060.00	
T 3.25 05/15/42	1,000,000.00	934,920.00	
T 3.25 06/30/29	3,000,000.00	2,964,960.00	
T 3.375 05/15/44	500,000.00	470,760.00	
T 3.375 08/15/42	1,000,000.00	953,670.00	
T 3.375 11/15/48	3,100,000.00	2,979,379.00	
T 3.5 02/15/39	200,000.00	201,140.00	
T 3.625 02/15/44	600,000.00	587,760.00	
T 3.625 08/15/43	2,400,000.00	2,358,936.00	
T 3.75 08/15/41	1,500,000.00	1,514,640.00	
T 3.75 11/15/43	700,000.00	700,294.00	
T 3.875 08/15/40	500,000.00	518,260.00	
T 4.25 05/15/39	100,000.00	110,183.00	
T 4.25 11/15/40	600,000.00	652,452.00	
T 4.375 05/15/40	900,000.00	999,135.00	
T 4.375 05/15/41	300,000.00	331,194.00	
T 4.375 11/15/39	300,000.00	334,476.00	

	T 4.5 08/15/39	300,000.00	340,125.00	
	T 4.625 02/15/40	1,100,000.00	1,262,591.00	
	T 4.75 02/15/41	900,000.00	1,044,063.00	
	T 5.25 11/15/28	500,000.00	548,785.00	
	T 5.375 02/15/31	320,000.00	367,024.00	
	T 6 02/15/26	1,000,000.00	1,077,570.00	
	T-BOND 15/11/2027	1,000,000.00	1,121,790.00	
	アメリカ・ドル小計	624,620,000.00	568,219,390.00 (81,153,093,280)	
カナダ・ ドル	CAN 0.5 09/01/25	2,700,000.00	2,474,631.00	
	CAN 1 06/01/27	600,000.00	542,952.00	
	CAN 1.25 06/01/30	5,700,000.00	4,966,353.00	
	CAN 1.5 04/01/25	700,000.00	665,091.00	
	CAN 1.5 06/01/26	3,200,000.00	2,998,112.00	
	CAN 1.5 09/01/24	2,200,000.00	2,114,046.00	
	CAN 1.5 12/01/31	1,900,000.00	1,651,442.00	
	CAN 1.75 12/01/53	500,000.00	361,565.00	
	CAN 2 06/01/28	700,000.00	657,797.00	
	CAN 2 09/01/23	700,000.00	688,457.00	
	CAN 2.25 03/01/24	1,000,000.00	980,480.00	
	CAN 2.25 06/01/25	500,000.00	484,165.00	
	CAN 2.25 06/01/29	1,800,000.00	1,705,212.00	
	CAN 2.25 12/01/29	1,600,000.00	1,510,944.00	
	CAN 2.5 06/01/24	2,100,000.00	2,062,200.00	
	CAN 2.75 12/01/48	1,500,000.00	1,390,065.00	
	CAN 3.5 12/01/45	1,200,000.00	1,258,944.00	
	CAN 4 06/01/41	1,600,000.00	1,775,968.00	
	CAN 5 06/01/37	600,000.00	723,738.00	
	CAN 5.75 06/01/29	250,000.00	289,187.50	
CAN 5.75 06/01/33	400,000.00	492,560.00		
CANADA 2.75 12/01/64	700,000.00	633,626.00		
	カナダ・ドル小計	32,150,000.00	30,427,535.50 (3,338,509,195)	
オースト ラリア・ ドル	ACGB 0.25 11/21/25	800,000.00	729,520.00	
	ACGB 1.5 06/21/31	4,700,000.00	3,984,519.00	
	ACGB 1.75 06/21/51	500,000.00	319,515.00	
	ACGB 2.25 05/21/28	1,800,000.00	1,700,784.00	
	ACGB 2.5 05/21/30	2,250,000.00	2,104,267.50	
	ACGB 2.75 04/21/24	2,500,000.00	2,492,975.00	
	ACGB 2.75 06/21/35	800,000.00	722,728.00	
	ACGB 2.75 11/21/27	900,000.00	876,879.00	
	ACGB 2.75 11/21/28	200,000.00	193,314.00	
	ACGB 2.75 11/21/29	1,800,000.00	1,722,528.00	
	ACGB 3 03/21/47	1,200,000.00	1,036,536.00	

	ACGB 3 11/21/33	1,000,000.00	943,980.00	
	ACGB 3.25 04/21/25	1,300,000.00	1,304,186.00	
	ACGB 3.25 04/21/29	800,000.00	793,456.00	
	ACGB 3.25 06/21/39	2,000,000.00	1,856,860.00	
	ACGB 3.75 04/21/37	1,200,000.00	1,197,276.00	
	ACGB 4.25 04/21/26	2,150,000.00	2,227,056.00	
	ACGB 4.5 04/21/33	900,000.00	972,738.00	
	オーストラリア・ドル小計	26,800,000.00	25,179,117.50 (2,461,258,736)	
シンガ ポール・ ドル	SIGB 1.25 11/01/26	250,000.00	233,575.00	
	SIGB 1.625 07/01/31	800,000.00	711,432.00	
	SIGB 2.25 08/01/36	800,000.00	722,040.00	
	SIGB 2.625 05/01/28	800,000.00	785,040.00	
	SIGB 2.75 03/01/46	800,000.00	747,600.00	
	SIGB 2.75 04/01/42	600,000.00	565,788.00	
	SIGB 2.875 09/01/30	200,000.00	197,500.00	
	SIGB 3 09/01/24	1,000,000.00	1,001,800.00	
	SIGB 3.375 09/01/33	300,000.00	307,950.00	
	SIGB 3.5 03/01/27	1,500,000.00	1,532,550.00	
	シンガポール・ドル小計	7,050,000.00	6,805,275.00 (694,818,578)	
イギリ ス・ボン ド	UK TSY GILT	800,000.00	562,480.00	
	UKT 0.125 01/30/26	1,500,000.00	1,362,375.00	
	UKT 0.125 01/31/28	500,000.00	429,395.00	
	UKT 0.25 01/31/25	700,000.00	653,695.00	
	UKT 0.25 07/31/31	1,300,000.00	1,013,155.00	
	UKT 0.375 10/22/26	400,000.00	359,200.00	
	UKT 0.375 10/22/30	1,800,000.00	1,458,810.00	
	UKT 0.5 01/31/29	700,000.00	596,603.00	
	UKT 0.5 10/22/61	100,000.00	39,282.00	
	UKT 0.625 06/07/25	500,000.00	469,680.00	
	UKT 0.625 07/31/35	400,000.00	283,820.00	
	UKT 0.875 10/22/29	500,000.00	432,025.00	
	UKT 1 01/31/32	1,300,000.00	1,071,512.00	
	UKT 1 04/22/24	800,000.00	774,392.00	
	UKT 1.125 10/22/73	300,000.00	147,807.00	
	UKT 1.25 07/22/27	200,000.00	184,240.00	
	UKT 1.25 07/31/51	500,000.00	297,500.00	
	UKT 1.5 07/22/26	1,100,000.00	1,041,337.00	
	UKT 1.5 07/22/47	2,000,000.00	1,325,820.00	
	UKT 1.625 10/22/28	300,000.00	277,617.00	
UKT 1.625 10/22/54	500,000.00	323,240.00		
UKT 1.75 01/22/49	1,250,000.00	871,750.00		
UKT 1.75 09/07/37	100,000.00	79,712.00		

	UKT 2 09/07/25	1,100,000.00	1,070,586.00	
	UKT 2.25 09/07/23	2,700,000.00	2,679,102.00	
	UKT 2.5 07/22/65	1,600,000.00	1,319,680.00	
	UKT 2.75 09/07/24	900,000.00	895,275.00	
	UKT 3.25 01/22/44	1,600,000.00	1,519,152.00	
	UKT 3.5 01/22/45	1,250,000.00	1,231,825.00	
	UKT 3.5 07/22/68	1,300,000.00	1,371,058.00	
	UKT 3.75 07/22/52	1,200,000.00	1,257,240.00	
	UKT 4 01/22/60	1,300,000.00	1,478,477.00	
	UKT 4.25 03/07/36	900,000.00	979,794.00	
	UKT 4.25 06/07/32	500,000.00	547,660.00	
	UKT 4.25 09/07/39	600,000.00	656,214.00	
	UKT 4.25 12/07/27	900,000.00	951,624.00	
	UKT 4.25 12/07/40	600,000.00	658,452.00	
	UKT 4.25 12/07/46	1,500,000.00	1,658,070.00	
	UKT 4.25 12/07/49	900,000.00	1,009,539.00	
	UKT 4.25 12/07/55	1,700,000.00	1,973,105.00	
	UKT 4.5 09/07/34	1,100,000.00	1,229,712.00	
	UKT 4.5 12/07/42	1,050,000.00	1,194,217.50	
	UKT 4.75 12/07/30	1,150,000.00	1,295,187.50	
	UKT 4.75 12/07/38	1,000,000.00	1,158,830.00	
	UKT 5 03/07/25	1,300,000.00	1,359,306.00	
	UKT 6 12/07/28	650,000.00	757,932.50	
	イギリス・ポンド小計	44,350,000.00	42,307,485.50 (7,017,542,620)	
イスラエル・シュケル	ILGOV 0.5 04/30/25	4,500,000.00	4,230,990.00	
	ILGOV 1 03/31/30	700,000.00	605,213.00	
	ILGOV 1.5 11/30/23	2,200,000.00	2,169,838.00	
	ILGOV 2.25 09/28/28	500,000.00	479,040.00	
	ILGOV 3.75 03/31/47	3,600,000.00	3,761,424.00	
	ILGOV 6.25 10/30/26	2,600,000.00	2,925,806.00	
	イスラエル・シュケル小計	14,100,000.00	14,172,311.00 (593,669,603)	
デンマーク・クローネ	DGB 0.25 11/15/52	1,800,000.00	1,051,506.00	
	DGB 0.5 11/15/27	8,000,000.00	7,486,000.00	
	DGB 0.5 11/15/29	4,800,000.00	4,351,632.00	
	DGB 1.5 11/15/23	1,900,000.00	1,908,645.00	
	DGB 1.75 11/15/25	3,600,000.00	3,617,928.00	
	DGB 4.5 11/15/39	8,200,000.00	10,926,910.00	
	デンマーク・クローネ小計	28,300,000.00	29,342,621.00 (567,486,290)	
ノルウェー・クローネ	NGB 1.375 08/19/30	4,200,000.00	3,632,916.00	
	NGB 1.5 02/19/26	3,000,000.00	2,821,650.00	
	NGB 1.75 03/13/25	3,000,000.00	2,886,180.00	

	NGB 1.75 09/06/29	4,700,000.00	4,240,434.00	
	NGB 2 04/26/28	7,000,000.00	6,519,310.00	
	NGB 3 03/14/24	2,800,000.00	2,791,320.00	
	ノルウェー・クローネ小計	24,700,000.00	22,891,810.00 (330,786,655)	
スウェーデン・クローナ	SGB 0.75 05/12/28	3,700,000.00	3,442,665.00	
	SGB 0.75 11/12/29	5,000,000.00	4,572,750.00	
	SGB 1 11/12/26	5,800,000.00	5,523,050.00	
	SGB 1.5 11/13/23	6,400,000.00	6,350,272.00	
	SGB 2.5 05/12/25	5,000,000.00	5,017,850.00	
	SGB 3.5 03/30/39	4,600,000.00	5,628,560.00	
	スウェーデン・クローナ小計	30,500,000.00	30,535,147.00 (411,919,133)	
メキシコ・ペソ	MBONO 10 12/05/24	32,000,000.00	32,259,840.00	
	MBONO 5.75 03/05/26	19,000,000.00	16,985,620.00	
	MBONO 7.5 06/03/27	16,000,000.00	15,091,520.00	
	MBONO 7.75 05/29/31	17,000,000.00	15,788,240.00	
	MBONO 7.75 11/23/34	18,000,000.00	16,292,880.00	
	MBONO 8 11/07/47	5,000,000.00	4,548,350.00	
	MBONO 8 12/07/23	21,000,000.00	20,507,130.00	
	MBONO 8.5 05/31/29	23,000,000.00	22,496,300.00	
	MBONO 8.5 11/18/38	40,000,000.00	38,244,000.00	
	メキシコ・ペソ小計	191,000,000.00	182,213,880.00 (1,310,117,797)	
オフショア・人民元	CGB 2.24 05/25/25	12,000,000.00	12,023,520.00	
	CGB 2.26 02/24/25	22,000,000.00	22,068,860.00	
	CGB 2.47 09/02/24	26,000,000.00	26,220,740.00	
	CGB 2.48 04/15/27	9,000,000.00	9,037,890.00	
	CGB 2.69 08/12/26	51,000,000.00	51,652,800.00	
	CGB 2.8 03/24/29	14,000,000.00	14,163,660.00	
	CGB 2.91 10/14/28	23,000,000.00	23,429,870.00	
	CGB 3.02 05/27/31	42,000,000.00	43,010,520.00	
	CGB 3.72 04/12/51	18,000,000.00	19,965,960.00	
	オフショア・人民元小計	217,000,000.00	221,573,820.00 (4,563,556,554)	
マレーシア・リングギット	MALAYSIA GOVT	700,000.00	702,667.00	
	MALAYSIA GOVT	1,500,000.00	1,519,005.00	
	MALAYSIA GOVT	700,000.00	706,153.00	
	MALAYSIA GOVT	800,000.00	733,160.00	
	MGS 3.502 05/31/27	5,100,000.00	5,043,747.00	
	MGS 3.955 09/15/25	3,200,000.00	3,244,512.00	
	MGS 4.498 04/15/30	6,000,000.00	6,191,460.00	
	MGS 4.736 03/15/46	6,700,000.00	6,867,634.00	
	マレーシア・リングギット小計	24,700,000.00	25,008,338.00 (793,734,638)	

ポーランド・ズロチ	POLGB 0.25 10/25/26	7,000,000.00	5,500,950.00	
	POLGB 0.75 04/25/25	1,800,000.00	1,574,190.00	
	POLGB 1.25 10/25/30	6,500,000.00	4,548,700.00	
	POLGB 2.25 10/25/24	10,400,000.00	9,575,904.00	
	POLGB 2.75 04/25/28	1,600,000.00	1,348,176.00	
ポーランド・ズロチ小計		27,300,000.00	22,547,920.00 (691,344,030)	
ユーロ	BGB 0 10/22/31	1,300,000.00	1,065,870.00	
	BGB 0.1 06/22/30	200,000.00	172,540.00	
	BGB 0.35 06/22/32	600,000.00	496,122.00	
	BGB 0.4 06/22/40	300,000.00	201,183.00	
	BGB 0.5 10/22/24	1,300,000.00	1,275,638.00	
	BGB 0.65 06/22/71	400,000.00	183,800.00	
	BGB 0.8 06/22/25	300,000.00	294,105.00	
	BGB 0.8 06/22/27	800,000.00	763,848.00	
	BGB 0.8 06/22/28	1,600,000.00	1,506,272.00	
	BGB 0.9 06/22/29	900,000.00	839,214.00	
	BGB 1 06/22/26	1,800,000.00	1,757,916.00	
	BGB 1 06/22/31	1,300,000.00	1,183,520.00	
	BGB 1.25 04/22/33	1,100,000.00	992,002.00	
	BGB 1.45 06/22/37	400,000.00	340,800.00	
	BGB 1.6 06/22/47	650,000.00	515,365.50	
	BGB 1.7 06/22/50	500,000.00	395,965.00	
	BGB 1.9 06/22/38	1,000,000.00	900,660.00	
	BGB 2.15 06/22/66	500,000.00	430,575.00	
	BGB 2.25 06/22/57	500,000.00	444,665.00	
	BGB 2.6 06/22/24	1,100,000.00	1,123,441.00	
	BGB 3 06/22/34	200,000.00	210,138.00	
	BGB 3.75 06/22/45	800,000.00	928,736.00	
	BGB 4 03/28/32	500,000.00	575,565.00	
	BGB 4.25 03/28/41	1,000,000.00	1,208,890.00	
	BGB 4.5 03/28/26	700,000.00	768,733.00	
	BGB 5 03/28/35	1,000,000.00	1,261,710.00	
	BGB 5.5 03/28/28	1,100,000.00	1,312,212.00	
	BTPS	2,400,000.00	2,292,600.00	
	BTPS 0 12/15/24	1,300,000.00	1,229,241.00	
	BTPS 0.35 02/01/25	2,400,000.00	2,279,328.00	
	BTPS 0.5 02/01/26	1,000,000.00	925,100.00	
	BTPS 0.65 10/15/23	700,000.00	689,514.00	
BTPS 0.85 01/15/27	1,700,000.00	1,550,876.00		
BTPS 0.9 04/01/31	2,000,000.00	1,584,120.00		
BTPS 0.95 06/01/32	1,000,000.00	764,560.00		
BTPS 0.95 08/01/30	1,800,000.00	1,465,884.00		
BTPS 0.95 09/15/27	800,000.00	718,280.00		

BTPS 0.95 12/01/31	2,600,000.00	2,018,822.00	
BTPS 1.1 04/01/27	1,800,000.00	1,645,038.00	
BTPS 1.25 12/01/26	800,000.00	745,664.00	
BTPS 1.45 03/01/36	400,000.00	294,696.00	
BTPS 1.45 05/15/25	700,000.00	677,971.00	
BTPS 1.45 11/15/24	1,800,000.00	1,762,704.00	
BTPS 1.5 06/01/25	1,900,000.00	1,843,627.00	
BTPS 1.6 06/01/26	1,200,000.00	1,146,264.00	
BTPS 1.65 12/01/30	2,200,000.00	1,880,934.00	
BTPS 1.7 09/01/51	1,500,000.00	921,840.00	
BTPS 1.85 05/15/24	3,000,000.00	2,975,880.00	
BTPS 1.85 07/01/25	1,000,000.00	977,220.00	
BTPS 2 02/01/28	3,900,000.00	3,664,986.00	
BTPS 2 12/01/25	1,300,000.00	1,269,073.00	
BTPS 2.05 08/01/27	1,500,000.00	1,425,060.00	
BTPS 2.1 07/15/26	1,000,000.00	970,330.00	
BTPS 2.2 06/01/27	900,000.00	864,036.00	
BTPS 2.25 09/01/36	500,000.00	406,235.00	
BTPS 2.45 09/01/33	1,100,000.00	949,454.00	
BTPS 2.45 09/01/50	900,000.00	656,604.00	
BTPS 2.5 11/15/25	1,200,000.00	1,188,840.00	
BTPS 2.5 12/01/24	1,300,000.00	1,301,547.00	
BTPS 2.7 03/01/47	1,550,000.00	1,225,337.00	
BTPS 2.8 03/01/67	600,000.00	453,894.00	
BTPS 2.8 12/01/28	1,600,000.00	1,550,080.00	
BTPS 2.95 09/01/38	600,000.00	521,196.00	
BTPS 3 08/01/29	1,600,000.00	1,553,296.00	
BTPS 3.1 03/01/40	500,000.00	437,560.00	
BTPS 3.25 09/01/46	1,500,000.00	1,312,950.00	
BTPS 3.35 03/01/35	850,000.00	790,525.50	
BTPS 3.45 03/01/48	1,000,000.00	899,040.00	
BTPS 3.5 03/01/30	3,400,000.00	3,395,002.00	
BTPS 3.75 09/01/24	2,300,000.00	2,360,927.00	
BTPS 3.85 09/01/49	1,100,000.00	1,050,357.00	
BTPS 4 02/01/37	2,600,000.00	2,597,426.00	
BTPS 4.5 03/01/24	1,000,000.00	1,033,310.00	
BTPS 4.5 03/01/26	1,800,000.00	1,902,222.00	
BTPS 4.75 09/01/28	2,000,000.00	2,148,860.00	
BTPS 4.75 09/01/44	800,000.00	872,416.00	
BTPS 5 03/01/25	1,000,000.00	1,058,730.00	
BTPS 5 08/01/34	2,070,000.00	2,257,500.60	
BTPS 5 08/01/39	1,800,000.00	2,006,748.00	
BTPS 5 09/01/40	1,700,000.00	1,888,241.00	
BTPS 5.75 02/01/33	1,700,000.00	1,958,791.00	

BTPS 6 05/01/31	2,200,000.00	2,575,188.00	
BTPS 6.5 11/01/27	1,700,000.00	1,974,686.00	
BTPS 7.25 11/01/26	400,000.00	468,724.00	
BTPS 9 11/01/23	300,000.00	322,929.00	
DBR 0 02/15/30	1,300,000.00	1,160,718.00	
DBR 0 02/15/32	1,600,000.00	1,370,880.00	
DBR 0 05/15/35	3,600,000.00	2,868,120.00	
DBR 0 08/15/29	2,200,000.00	1,981,672.00	
DBR 0 08/15/30	5,800,000.00	5,127,374.00	
DBR 0 08/15/31	1,500,000.00	1,301,745.00	
DBR 0 08/15/50	2,800,000.00	1,705,592.00	
DBR 0.25 02/15/27	2,300,000.00	2,188,933.00	
DBR 0.25 02/15/29	1,800,000.00	1,661,940.00	
DBR 0.25 08/15/28	1,500,000.00	1,393,710.00	
DBR 0.5 02/15/25	2,500,000.00	2,455,000.00	
DBR 0.5 02/15/26	3,100,000.00	3,016,424.00	
DBR 0.5 02/15/28	2,100,000.00	1,992,144.00	
DBR 0.5 08/15/27	1,000,000.00	956,130.00	
DBR 1 05/15/38	1,000,000.00	882,080.00	
DBR 1 08/15/24	1,300,000.00	1,296,165.00	
DBR 1 08/15/25	1,300,000.00	1,290,237.00	
DBR 1.25 08/15/48	1,450,000.00	1,291,558.50	
DBR 1.5 05/15/24	2,200,000.00	2,214,696.00	
DBR 1.75 02/15/24	2,200,000.00	2,224,046.00	
DBR 2.5 07/04/44	1,900,000.00	2,134,688.00	
DBR 2.5 08/15/46	2,400,000.00	2,736,336.00	
DBR 3.25 07/04/42	700,000.00	868,833.00	
DBR 4 01/04/37	1,800,000.00	2,288,412.00	
DBR 4.25 07/04/39	700,000.00	941,941.00	
DBR 4.75 07/04/28	1,600,000.00	1,883,728.00	
DBR 4.75 07/04/34	600,000.00	794,292.00	
DBR 4.75 07/04/40	1,450,000.00	2,085,303.00	
DBR 5.5 01/04/31	900,000.00	1,173,402.00	
DBR 5.625 01/04/28	1,000,000.00	1,208,760.00	
DBR 6.25 01/04/24	1,200,000.00	1,282,020.00	
DBR 6.25 01/04/30	500,000.00	662,200.00	
DBR 6.5 07/04/27	1,000,000.00	1,230,320.00	
FRTR 0 02/25/24	1,900,000.00	1,867,833.00	
FRTR 0 02/25/25	3,000,000.00	2,886,660.00	
FRTR 0 02/25/26	3,800,000.00	3,596,054.00	
FRTR 0 03/25/24	4,800,000.00	4,708,608.00	
FRTR 0 03/25/25	1,900,000.00	1,827,382.00	
FRTR 0 05/25/32	500,000.00	404,440.00	
FRTR 0 11/25/29	4,500,000.00	3,915,045.00	

FRTR 0 11/25/30	3,900,000.00	3,303,300.00	
FRTR 0 11/25/31	3,000,000.00	2,470,650.00	
FRTR 0.25 11/25/26	3,200,000.00	3,012,384.00	
FRTR 0.5 05/25/25	1,300,000.00	1,263,574.00	
FRTR 0.5 05/25/26	3,500,000.00	3,356,885.00	
FRTR 0.5 05/25/29	1,600,000.00	1,458,448.00	
FRTR 0.5 05/25/72	100,000.00	44,124.00	
FRTR 0.5 06/25/44	800,000.00	525,344.00	
FRTR 0.75 02/25/28	500,000.00	470,525.00	
FRTR 0.75 05/25/28	3,300,000.00	3,101,340.00	
FRTR 0.75 05/25/52	3,000,000.00	1,846,200.00	
FRTR 0.75 11/25/28	3,500,000.00	3,267,845.00	
FRTR 1 05/25/27	1,800,000.00	1,737,630.00	
FRTR 1 11/25/25	1,000,000.00	981,840.00	
FRTR 1.25 05/25/34	1,200,000.00	1,056,624.00	
FRTR 1.25 05/25/36	3,700,000.00	3,155,804.00	
FRTR 1.5 05/25/31	2,550,000.00	2,447,056.50	
FRTR 1.5 05/25/50	2,400,000.00	1,865,904.00	
FRTR 1.75 05/25/66	800,000.00	632,584.00	
FRTR 1.75 06/25/39	3,200,000.00	2,862,240.00	
FRTR 1.75 11/25/24	2,600,000.00	2,615,574.00	
FRTR 2 05/25/48	2,000,000.00	1,761,920.00	
FRTR 2.25 05/25/24	1,700,000.00	1,726,928.00	
FRTR 2.5 05/25/30	3,500,000.00	3,642,660.00	
FRTR 2.75 10/25/27	3,850,000.00	4,027,061.50	
FRTR 3.25 05/25/45	900,000.00	992,853.00	
FRTR 3.5 04/25/26	2,500,000.00	2,663,000.00	
FRTR 4 04/25/55	1,370,000.00	1,760,737.70	
FRTR 4 04/25/60	1,400,000.00	1,853,544.00	
FRTR 4 10/25/38	2,000,000.00	2,373,080.00	
FRTR 4.25 10/25/23	1,000,000.00	1,033,800.00	
FRTR 4.5 04/25/41	2,000,000.00	2,549,820.00	
FRTR 4.75 04/25/35	2,200,000.00	2,743,752.00	
FRTR 5.5 04/25/29	2,350,000.00	2,867,188.00	
FRTR 5.75 10/25/32	400,000.00	526,056.00	
FRTR 6 10/25/25	2,100,000.00	2,381,631.00	
IRISH 0 10/18/31	500,000.00	411,645.00	
IRISH 0.9 05/15/28	500,000.00	473,110.00	
IRISH 1 05/15/26	800,000.00	782,472.00	
IRISH 1.1 05/15/29	1,000,000.00	945,850.00	
IRISH 1.3 05/15/33	800,000.00	723,968.00	
IRISH 1.35 03/18/31	500,000.00	473,820.00	
IRISH 1.5 05/15/50	500,000.00	385,050.00	
IRISH 1.7 05/15/37	300,000.00	270,141.00	

IRISH 2 02/18/45	900,000.00	803,151.00	
IRISH 2.4 05/15/30	600,000.00	618,390.00	
IRISH 3.4 03/18/24	500,000.00	515,525.00	
IRISH 5.4 03/13/25	800,000.00	876,120.00	
NETHER 0 01/15/24	1,000,000.00	984,250.00	
NETHER 0 01/15/27	800,000.00	745,872.00	
NETHER 0 07/15/30	2,600,000.00	2,257,632.00	
NETHER 0.25 07/15/25	1,100,000.00	1,062,358.00	
NETHER 0.25 07/15/29	500,000.00	450,515.00	
NETHER 0.5 01/15/40	1,700,000.00	1,300,857.00	
NETHER 0.5 07/15/26	1,700,000.00	1,631,575.00	
NETHER 0.75 07/15/27	400,000.00	383,460.00	
NETHER 0.75 07/15/28	1,500,000.00	1,419,270.00	
NETHER 2 07/15/24	1,000,000.00	1,013,220.00	
NETHER 2.5 01/15/33	200,000.00	208,826.00	
NETHER 2.75 01/15/47	1,500,000.00	1,681,065.00	
NETHER 3.75 01/15/42	1,300,000.00	1,630,239.00	
NETHER 4 01/15/37	1,400,000.00	1,713,894.00	
NETHER 5.5 01/15/28	700,000.00	834,561.00	
OBL 0 04/05/24	1,300,000.00	1,278,524.00	
OBL 0 04/11/25	2,800,000.00	2,710,260.00	
OBL 0 04/16/27	3,300,000.00	3,088,437.00	
OBL 0 10/09/26	1,100,000.00	1,038,587.00	
OBL 0 10/10/25	1,800,000.00	1,731,420.00	
OBL 0 10/13/23	1,600,000.00	1,583,040.00	
OBL 0 10/18/24	600,000.00	584,868.00	
RAGB 0 02/20/30	900,000.00	769,896.00	
RAGB 0 02/20/31	900,000.00	748,971.00	
RAGB 0.5 02/20/29	550,000.00	499,510.00	
RAGB 0.5 04/20/27	700,000.00	661,339.00	
RAGB 0.75 02/20/28	700,000.00	657,377.00	
RAGB 0.75 03/20/51	900,000.00	582,030.00	
RAGB 0.75 10/20/26	900,000.00	866,412.00	
RAGB 0.85 06/30/20	150,000.00	66,669.00	
RAGB 0.9 02/20/32	300,000.00	264,465.00	
RAGB 1.2 10/20/25	1,000,000.00	988,330.00	
RAGB 1.5 02/20/47	700,000.00	577,129.00	
RAGB 1.5 11/02/86	200,000.00	135,956.00	
RAGB 1.65 10/21/24	800,000.00	804,312.00	
RAGB 1.75 10/20/23	1,000,000.00	1,007,640.00	
RAGB 2.4 05/23/34	900,000.00	898,857.00	
RAGB 3.15 06/20/44	700,000.00	781,683.00	
RAGB 3.8 01/26/62	700,000.00	908,208.00	
RAGB 4.15 03/15/37	300,000.00	361,125.00	

RAGB 4.85 03/15/26	500,000.00	556,055.00	
RAGB 6.25 07/15/27	1,000,000.00	1,207,780.00	
RFGB 0.25 09/15/40	400,000.00	270,196.00	
RFGB 0.5 04/15/26	800,000.00	768,664.00	
RFGB 0.5 09/15/28	400,000.00	368,084.00	
RFGB 0.5 09/15/29	800,000.00	722,184.00	
RFGB 0.75 04/15/31	500,000.00	447,235.00	
RFGB 1.375 04/15/47	300,000.00	243,573.00	
RFGB 2 04/15/24	900,000.00	911,889.00	
RFGB 2.625 07/04/42	800,000.00	811,048.00	
RFGB 2.75 07/04/28	400,000.00	419,464.00	
RFGB 4 07/04/25	300,000.00	321,438.00	
SPGB 0 01/31/25	500,000.00	479,995.00	
SPGB 0.25 07/30/24	1,400,000.00	1,365,462.00	
SPGB 0.5 04/30/30	1,000,000.00	864,710.00	
SPGB 0.5 10/31/31	1,400,000.00	1,155,000.00	
SPGB 0.7 04/30/32	2,000,000.00	1,654,560.00	
SPGB 0.8 07/30/27	1,000,000.00	938,800.00	
SPGB 1 10/31/50	300,000.00	176,646.00	
SPGB 1.2 10/31/40	1,700,000.00	1,229,304.00	
SPGB 1.25 10/31/30	3,000,000.00	2,718,690.00	
SPGB 1.3 10/31/26	3,100,000.00	3,018,439.00	
SPGB 1.4 04/30/28	1,600,000.00	1,531,840.00	
SPGB 1.4 07/30/28	2,200,000.00	2,096,314.00	
SPGB 1.45 04/30/29	2,000,000.00	1,892,900.00	
SPGB 1.45 10/31/27	600,000.00	579,636.00	
SPGB 1.45 10/31/71	400,000.00	210,144.00	
SPGB 1.5 04/30/27	1,500,000.00	1,461,150.00	
SPGB 1.6 04/30/25	1,400,000.00	1,394,946.00	
SPGB 1.85 07/30/35	2,000,000.00	1,757,120.00	
SPGB 1.95 04/30/26	2,000,000.00	1,999,220.00	
SPGB 1.95 07/30/30	1,700,000.00	1,633,343.00	
SPGB 2.15 10/31/25	1,600,000.00	1,616,592.00	
SPGB 2.35 07/30/33	700,000.00	667,779.00	
SPGB 2.7 10/31/48	750,000.00	680,302.50	
SPGB 2.75 10/31/24	2,100,000.00	2,150,484.00	
SPGB 2.9 10/31/46	1,700,000.00	1,614,694.00	
SPGB 3.45 07/30/66	1,300,000.00	1,278,238.00	
SPGB 3.8 04/30/24	1,400,000.00	1,451,408.00	
SPGB 4.2 01/31/37	1,250,000.00	1,417,800.00	
SPGB 4.4 10/31/23	1,000,000.00	1,034,150.00	
SPGB 4.65 07/30/25	1,300,000.00	1,406,132.00	
SPGB 4.7 07/30/41	1,500,000.00	1,826,415.00	
SPGB 4.8 01/31/24	2,200,000.00	2,303,158.00	

	SPGB 4.9 07/30/40	1,200,000.00	1,487,772.00	
	SPGB 5.15 10/31/28	1,500,000.00	1,742,205.00	
	SPGB 5.15 10/31/44	1,000,000.00	1,309,440.00	
	SPGB 5.75 07/30/32	1,000,000.00	1,265,040.00	
	SPGB 5.9 07/30/26	500,000.00	574,410.00	
	SPGB 6 01/31/29	2,200,000.00	2,685,298.00	
	ユーロ小計	374,040,000.00	364,016,105.30 (52,356,436,425)	
国債証券合計			156,284,273,534 (156,284,273,534)	
合 計			156,284,273,534 (156,284,273,534)	

(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	206銘柄	51.4%	51.9%
カナダ・ドル	国債証券	22銘柄	2.1%	2.1%
オーストラリア・ドル	国債証券	18銘柄	1.6%	1.6%
シンガポール・ドル	国債証券	10銘柄	0.4%	0.4%
イギリス・ポンド	国債証券	46銘柄	4.4%	4.5%
イスラエル・シケル	国債証券	6銘柄	0.4%	0.4%
デンマーク・クローネ	国債証券	6銘柄	0.4%	0.4%
ノルウェー・クローネ	国債証券	6銘柄	0.2%	0.2%
スウェーデン・クローナ	国債証券	6銘柄	0.3%	0.3%
メキシコ・ペソ	国債証券	9銘柄	0.8%	0.8%
オフショア・人民元	国債証券	9銘柄	2.9%	2.9%
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	263銘柄	33.2%	33.5%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

（1）貸借対照表

（単位：円）

	（2021年9月10日現在）	（2022年9月12日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	674,283,873	89,834,626
コール・ローン	1,305,798,539	2,524,951,156
株式	207,943,757,270	214,676,540,430
派生商品評価勘定	11,265,900	67,567,100
未収入金	5,454,800	-
未収配当金	84,277,534	107,003,079
差入委託証拠金	75,463,000	112,590,000

流動資産合計	210,100,300,916	217,578,486,391
資産合計	210,100,300,916	217,578,486,391
負債の部		
流動負債		
前受金	11,322,000	53,125,000
未払解約金	529,677,177	116,384,998
未払利息	2,880	-
その他未払費用	74,091	11,209
流動負債合計	541,076,148	169,521,207
負債合計	541,076,148	169,521,207
純資産の部		
元本等		
元本	60,456,249,906	64,681,311,514
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	149,102,974,862	152,727,653,670
元本等合計	209,559,224,768	217,408,965,184
純資産合計	209,559,224,768	217,408,965,184
負債純資産合計	210,100,300,916	217,578,486,391

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2021年9月11日 至 2022年9月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年9月10日現在)	(2022年9月12日現在)
1. 当計算期間の末日における 受益権の総数	60,456,249,906口	64,681,311,514口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.4663円 (1万口当たりの純資産額34,663円)	1口当たり純資産額 3.3612円 (1万口当たりの純資産額33,612円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年9月11日 至 2022年9月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

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

・金融商品の時価等に関する事項

項 目	(2022年9月12日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年9月10日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

		契 約 額 等		
--	--	---------	--	--

区 分	種 類		うち 1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX先物	1,045,964,100	-	1,057,230,000	11,265,900
	小計	1,045,964,100	-	1,057,230,000	11,265,900
合 計		1,045,964,100	-	1,057,230,000	11,265,900

(2022年9月12日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物 0412月	2,654,052,900	-	2,721,620,000	67,567,100
	小計	2,654,052,900	-	2,721,620,000	67,567,100
合 計		2,654,052,900	-	2,721,620,000	67,567,100

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2021年9月11日 至 2022年9月12日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2021年9月10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	65,642,531,273円
同期中における追加設定元本額	9,902,713,440円
同期中における一部解約元本額	15,088,994,807円
2021年9月10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	9,379,403,856円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	909,675,852円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,455,635,202円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,352,534,788円

SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	143,884,400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)	4,736,179円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	20,511,740円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	62,883,753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)	143,476,016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)	118,710,414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)	215,267,876円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,181,014,563円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	17,257,669,739円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	201,345,776円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	251,210,761円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	167,416,229円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	28,367,994円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	147,720,164円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	133,196,842円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	447,445,953円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	224,977,146円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	261,468,545円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	30,472,204円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	382,708,260円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	13,864,916円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	66,276,238円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	63,520,057円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	3,863,277円
日興FWS・日本株インデックス	310,888円
三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド	382,137円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,918,982,335円
バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	13,424,861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 >	115,503,299円
SMAM・バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 >	1,963,923,797円
SMAM・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	1,748,611,027円
SMAM・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	6,626,254,632円
SMAM・バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 >	43,639,644円
SMAM・バランスファンドVL50 < 適格機関投資家限定 >	177,043,333円
SMAM・バランスファンドVA75 < 適格機関投資家専用 >	777,143,594円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	47,588,920円
SMAM・インデックス・バランスVA25 < 適格機関投資家専用 >	279,517,682円
SMAM・インデックス・バランスVA50 < 適格機関投資家専用 >	896,070,775円
SMAM・バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 >	642,840,596円
SMAM・バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 >	2,010,301,600円
SMAM・バランスVA株40T < 適格機関投資家限定 >	380,313円
SMAM・グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	45,653,025円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 >	51,538,337円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A < 適格機関投資家専用 >	35,737,801円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A < 適格機関投資家専用 >	16,949,666円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L < 適格機関投資家専用 >	122,030,038円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 >	266,425,624円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2 < 適格機関投資家専用 >	68,194,442円

SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	41,736,057円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	7,545,581円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	48,295,560円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	646,556,597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）	187,838,271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>	248,544,531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>	114,606,601円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	327,199,136円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	74,013,645円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	27,701,727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>	58,420,144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>	63,463,668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>	72,621,282円
合計	60,456,249,906円

(2022年9月12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	60,456,249,906円
同期中における追加設定元本額	12,113,029,153円
同期中における一部解約元本額	7,887,967,545円

2022年9月12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	9,532,155,480円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	1,024,578,616円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	4,612,955,175円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	3,551,056,908円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	122,904,750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）	4,296,896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）	19,400,437円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）	62,615,670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）	164,050,569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）	145,160,441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）	260,258,888円
国内株式指数ファンド（TOPIX）	1,387,774,054円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	21,027,174,341円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	131,058,857円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	212,157,060円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	139,804,903円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	38,125,053円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	191,441,180円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	177,791,284円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	646,292,493円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	357,670,813円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	410,137,910円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	48,149,518円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	752,883,758円
三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）	39,292,044円

三井住友DS・年金バランス50(標準型)	191,390,450円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	181,956,760円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	5,290,169円
日興FWS・日本株インデックス	1,165,067,037円
三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド	14,503,710円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,659,870,089円
バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	12,478,245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 >	81,298,159円
SMAM・バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 >	1,595,955,250円
SMAM・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	1,545,408,479円
SMAM・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	5,856,077,396円
SMAM・バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 >	38,205,939円
SMAM・バランスファンドVL50 < 適格機関投資家限定 >	147,542,596円
SMAM・バランスファンドVA75 < 適格機関投資家専用 >	694,789,862円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	46,213,392円
SMAM・インデックス・バランスVA25 < 適格機関投資家専用 >	254,234,553円
SMAM・インデックス・バランスVA50 < 適格機関投資家専用 >	801,202,128円
SMAM・バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 >	559,229,424円
SMAM・バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 >	1,751,291,234円
SMAM・バランスVA株40T < 適格機関投資家限定 >	372,784円
SMAM・グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	38,293,008円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 >	44,291,667円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A < 適格機関投資家専用 >	32,479,210円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A < 適格機関投資家専用 >	16,874,370円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L < 適格機関投資家専用 >	104,754,643円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 >	232,670,128円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2 < 適格機関投資家専用 >	54,509,181円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2 < 適格機関投資家専用 >	40,288,518円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2 < 適格機関投資家専用 >	7,737,301円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2 < 適格機関投資家専用 >	42,362,287円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2 < 適格機関投資家専用 >	564,856,832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)	178,230,052円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA < 適格機関投資家限定 >	211,396,741円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA < 適格機関投資家限定 >	95,343,921円
SMAM・世界バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 >	113,317,327円
SMAM・世界バランスファンドVA2 < 適格機関投資家限定 >	47,780,927円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	45,022,020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 >	33,345,709円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	42,282,418円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	55,774,152円
SMDAM・日米3資産バランスオープン < 適格機関投資家限定 >	18,136,348円
合計	64,681,311,514円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

(単位: 円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	3,500	3,660.000	12,810,000	
日本水産	106,900	549.000	58,688,100	
マルハニチロ	14,800	2,435.000	36,038,000	
雪国まいたけ	10,000	1,004.000	10,040,000	
カネコ種苗	5,900	1,580.000	9,322,000	
サカタのタネ	12,500	5,190.000	64,875,000	
ホクト	8,500	1,909.000	16,226,500	
日鉄鉱業	2,400	6,040.000	14,496,000	
三井松島ホールディングス	5,200	3,510.000	18,252,000	
I N P E X	365,300	1,493.000	545,392,900	
石油資源開発	13,700	3,775.000	51,717,500	
K & Oエナジーグループ	5,200	1,711.000	8,897,200	
ショーボンドホールディングス	13,400	6,200.000	83,080,000	
ミライト・ワン	36,900	1,556.000	57,416,400	
タマホーム	7,100	2,341.000	16,621,100	
Robot Home	19,800	188.000	3,722,400	
安藤・間	52,300	901.000	47,122,300	
東急建設	33,500	674.000	22,579,000	
コムシスホールディングス	36,900	2,653.000	97,895,700	
ピーアールホールディングス	20,400	352.000	7,180,800	
高松コンストラクショングループ	7,400	1,930.000	14,282,000	
東建コーポレーション	3,100	8,500.000	26,350,000	
ヤマウラ	7,600	966.000	7,341,600	
オリエンタル白石	42,200	256.000	10,803,200	
大成建設	73,900	4,255.000	314,444,500	
大林組	245,800	974.000	239,409,200	
清水建設	227,500	766.000	174,265,000	
飛島建設	9,700	1,076.000	10,437,200	
長谷工コーポレーション	70,800	1,641.000	116,182,800	
松井建設	9,700	592.000	5,742,400	
銭高組	2,500	3,240.000	8,100,000	
鹿島建設	180,200	1,490.000	268,498,000	
不動テトラ	6,400	1,556.000	9,958,400	
大末建設	3,900	1,545.000	6,025,500	
鉄建建設	7,100	1,806.000	12,822,600	
西松建設	16,500	4,105.000	67,732,500	
三井住友建設	63,500	451.000	28,638,500	
大豊建設	4,100	4,120.000	16,892,000	
奥村組	13,200	2,978.000	39,309,600	
東鉄工業	10,400	2,348.000	24,419,200	
浅沼組	6,400	2,841.000	18,182,400	
戸田建設	101,400	762.000	77,266,800	
熊谷組	13,100	2,635.000	34,518,500	
北野建設	5,000	2,399.000	11,995,000	
矢作建設工業	10,900	778.000	8,480,200	
ピーエス三菱	10,100	659.000	6,655,900	

日本ハウスホールディングス	17,000	452.000	7,684,000
大東建託	27,200	14,630.000	397,936,000
新日本建設	10,700	718.000	7,682,600
東亜道路工業	1,600	5,990.000	9,584,000
日本道路	2,400	6,210.000	14,904,000
東亜建設工業	6,300	2,458.000	15,485,400
日本国土開発	21,500	612.000	13,158,000
若築建設	4,700	2,294.000	10,781,800
東洋建設	30,600	872.000	26,683,200
五洋建設	99,200	743.000	73,705,600
世紀東急工業	13,200	775.000	10,230,000
福田組	2,600	4,900.000	12,740,000
住友林業	52,800	2,347.000	123,921,600
日本基礎技術	13,100	515.000	6,746,500
巴コーポレーション	19,300	428.000	8,260,400
大和ハウス工業	210,100	3,127.000	656,982,700
ライト工業	13,800	1,929.000	26,620,200
積水ハウス	252,000	2,534.500	638,694,000
日特建設	6,800	937.000	6,371,600
北陸電気工事	1,100	754.000	829,400
ユアテック	14,700	759.000	11,157,300
日本リーテック	5,800	817.000	4,738,600
中電工	8,500	2,151.000	18,283,500
関電工	39,600	846.000	33,501,600
きんでん	52,000	1,523.000	79,196,000
東京エネシス	8,500	1,023.000	8,695,500
トーエネック	2,800	3,540.000	9,912,000
住友電設	6,200	2,702.000	16,752,400
日本電設工業	10,400	1,814.000	18,865,600
エクシオグループ	36,500	2,181.000	79,606,500
新日本空調	5,900	1,869.000	11,027,100
九電工	17,000	2,901.000	49,317,000
三機工業	16,900	1,696.000	28,662,400
日揮ホールディングス	75,400	1,969.000	148,462,600
中外炉工業	3,600	1,614.000	5,810,400
ヤマト	11,900	790.000	9,401,000
太平電業	4,900	3,540.000	17,346,000
高砂熱学工業	19,800	1,665.000	32,967,000
朝日工業社	3,600	1,872.000	6,739,200
明星工業	14,400	746.000	10,742,400
大気社	10,900	3,320.000	36,188,000
ダイダン	5,100	2,292.000	11,689,200
日比谷総合設備	7,200	1,902.000	13,694,400
テスホールディングス	8,200	1,115.000	9,143,000
インフロニア・ホールディングス	92,500	1,018.000	94,165,000
東洋エンジニアリング	12,500	671.000	8,387,500
レイズネクスト	10,800	1,215.000	13,122,000
ニッポン	19,900	1,566.000	31,163,400

日清製粉グループ本社	79,700	1,538.000	122,578,600
日東富士製粉	600	4,715.000	2,829,000
昭和産業	6,400	2,540.000	16,256,000
中部飼料	8,800	1,078.000	9,486,400
フィード・ワン	10,300	705.000	7,261,500
日本甜菜製糖	5,200	1,622.000	8,434,400
D M三井製糖ホールディングス	6,500	1,861.000	12,096,500
日新製糖	4,000	1,779.000	7,116,000
森永製菓	17,300	3,850.000	66,605,000
中村屋	2,800	3,120.000	8,736,000
江崎グリコ	19,900	3,500.000	69,650,000
名糖産業	3,600	1,650.000	5,940,000
井村屋グループ	4,400	2,240.000	9,856,000
不二家	4,600	2,382.000	10,957,200
山崎製パン	46,900	1,622.000	76,071,800
モロゾフ	2,900	3,715.000	10,773,500
亀田製菓	4,400	4,430.000	19,492,000
寿スピリッツ	7,400	8,490.000	62,826,000
カルビー	39,100	2,763.000	108,033,300
森永乳業	14,600	4,085.000	59,641,000
六甲バター	5,300	1,439.000	7,626,700
ヤクルト本社	54,000	8,210.000	443,340,000
明治ホールディングス	46,800	6,530.000	305,604,000
雪印メグミルク	18,800	1,693.000	31,828,400
プリマハム	10,400	2,075.000	21,580,000
日本ハム	29,900	3,950.000	118,105,000
丸大食品	8,500	1,515.000	12,877,500
S Foods	7,600	2,940.000	22,344,000
柿安本店	3,100	2,287.000	7,089,700
伊藤ハム米久ホールディングス	48,700	662.000	32,239,400
サッポロホールディングス	23,000	3,120.000	71,760,000
アサヒグループホールディングス	160,100	4,683.000	749,748,300
キリンホールディングス	312,900	2,240.500	701,052,450
宝ホールディングス	47,000	1,091.000	51,277,000
オエノンホールディングス	23,700	289.000	6,849,300
養命酒製造	1,400	1,809.000	2,532,600
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	54,400	1,405.000	76,432,000
サントリー食品インターナショナル	48,600	5,170.000	251,262,000
ダイドーグループホールディングス	4,300	4,695.000	20,188,500
伊藤園	25,800	6,000.000	154,800,000
キーコーヒー	7,900	2,121.000	16,755,900
日清オイリオグループ	9,500	3,200.000	30,400,000
不二製油グループ本社	18,800	2,392.000	44,969,600
かどや製油	3,100	3,555.000	11,020,500
J - オイルミルズ	8,000	1,576.000	12,608,000
キッコーマン	50,800	8,740.000	443,992,000
味の素	169,800	3,986.000	676,822,800

ブルドックソース	3,500	1,839.000	6,436,500
キューピー	37,200	2,239.000	83,290,800
ハウス食品グループ本社	26,300	2,974.000	78,216,200
カゴメ	32,300	2,990.000	96,577,000
焼津水産化学工業	13,700	877.000	12,014,900
アリアケジャパン	7,700	4,530.000	34,881,000
ニチレイ	32,200	2,456.000	79,083,200
東洋水産	38,000	5,780.000	219,640,000
イトアンドホールディングス	4,000	2,143.000	8,572,000
日清食品ホールディングス	27,400	9,830.000	269,342,000
永谷園ホールディングス	4,300	2,012.000	8,651,600
フジッコ	7,900	1,900.000	15,010,000
ロック・フィールド	8,700	1,507.000	13,110,900
日本たばこ産業	456,100	2,394.000	1,091,903,400
ケンコーマヨネーズ	4,900	1,533.000	7,511,700
わらべや日洋ホールディングス	5,500	2,246.000	12,353,000
なとり	5,300	2,065.000	10,944,500
ファーマフーズ	10,900	1,373.000	14,965,700
ユーグレナ	46,100	970.000	44,717,000
紀文食品	7,700	988.000	7,607,600
ピクルスホールディングス	5,000	1,100.000	5,500,000
ミヨシ油脂	1,300	996.000	1,294,800
理研ビタミン	6,300	1,748.000	11,012,400
片倉工業	8,500	2,011.000	17,093,500
ゲンゼ	4,900	3,905.000	19,134,500
東洋紡	35,000	1,109.000	38,815,000
ユニチカ	32,200	273.000	8,790,600
富士紡ホールディングス	3,700	3,545.000	13,116,500
倉敷紡績	6,400	2,164.000	13,849,600
シキボウ	8,600	891.000	7,662,600
日本毛織	20,800	1,075.000	22,360,000
帝国繊維	8,300	1,626.000	13,495,800
帝人	73,900	1,473.000	108,854,700
東レ	516,600	795.000	410,697,000
アツギ	15,000	406.000	6,090,000
ダイニック	3,300	614.000	2,026,200
セーレン	15,400	2,122.000	32,678,800
小松マテーレ	13,100	842.000	11,030,200
ワコールホールディングス	17,300	2,258.000	39,063,400
ホギメディカル	10,500	3,490.000	36,645,000
T S Iホールディングス	28,600	417.000	11,926,200
ワールド	11,600	1,402.000	16,263,200
三陽商会	5,400	967.000	5,221,800
オンワードホールディングス	52,100	293.000	15,265,300
ゴールドウイン	13,700	7,940.000	108,778,000
デサント	14,200	3,600.000	51,120,000
特種東海製紙	4,800	3,135.000	15,048,000
王子ホールディングス	319,900	558.000	178,504,200

日本製紙	34,100	883.000	30,110,300
北越コーポレーション	50,000	754.000	37,700,000
大王製紙	35,900	1,231.000	44,192,900
レンゴー	65,900	844.000	55,619,600
トーモク	5,100	1,525.000	7,777,500
ザ・バック	5,600	2,315.000	12,964,000
北の達人コーポレーション	33,100	260.000	8,606,000
クラレ	112,300	1,075.000	120,722,500
旭化成	512,400	1,046.000	535,970,400
昭和電工	68,200	2,179.000	148,607,800
住友化学	564,100	553.000	311,947,300
住友精化	3,500	3,330.000	11,655,000
日産化学	37,300	7,170.000	267,441,000
ラサ工業	3,500	2,473.000	8,655,500
クレハ	5,900	9,670.000	57,053,000
多木化学	2,800	5,110.000	14,308,000
テイカ	4,900	1,298.000	6,360,200
石原産業	15,200	1,073.000	16,309,600
日本曹達	9,100	4,570.000	41,587,000
東ソー	102,100	1,844.000	188,272,400
トクヤマ	25,200	1,893.000	47,703,600
セントラル硝子	12,500	3,460.000	43,250,000
東亜合成	35,600	1,132.000	40,299,200
大阪ソーダ	6,300	3,895.000	24,538,500
関東電化工業	16,100	1,025.000	16,502,500
デンカ	28,000	3,380.000	94,640,000
信越化学工業	131,500	16,715.000	2,198,022,500
日本カーバイド工業	4,300	1,264.000	5,435,200
堺化学工業	5,700	1,981.000	11,291,700
第一稀元素化学工業	7,900	1,435.000	11,336,500
エア・ウォーター	66,300	1,766.000	117,085,800
日本酸素ホールディングス	67,700	2,569.000	173,921,300
日本化学工業	3,000	2,083.000	6,249,000
日本パーカライズニング	33,500	990.000	33,165,000
高圧ガス工業	12,200	681.000	8,308,200
四国化成工業	9,300	1,296.000	12,052,800
ステラ ケミファ	4,500	2,745.000	12,352,500
保土谷化学工業	2,500	3,295.000	8,237,500
日本触媒	11,700	5,720.000	66,924,000
大日精化工業	6,100	1,805.000	11,010,500
カネカ	17,600	4,005.000	70,488,000
三菱瓦斯化学	65,000	2,110.000	137,150,000
三井化学	64,200	3,155.000	202,551,000
J S R	77,300	3,155.000	243,881,500
東京応化工業	12,400	6,780.000	84,072,000
大阪有機化学工業	5,400	2,384.000	12,873,600
三菱ケミカルグループ	516,300	734.200	379,067,460
K Hネオケム	11,700	2,677.000	31,320,900

ダイセル	111,900	914.000	102,276,600
住友ベークライト	11,700	4,590.000	53,703,000
積水化学工業	157,300	1,937.000	304,690,100
日本ゼオン	62,100	1,431.000	88,865,100
アイカ工業	19,600	3,230.000	63,308,000
U B E	39,100	2,081.000	81,367,100
積水樹脂	10,900	1,769.000	19,282,100
タキロンシーアイ	17,700	542.000	9,593,400
旭有機材	4,900	2,410.000	11,809,000
ニチバン	4,900	1,700.000	8,330,000
リケンテクノス	16,700	534.000	8,917,800
大倉工業	3,700	1,801.000	6,663,700
積水化成成品工業	9,000	414.000	3,726,000
群栄化学工業	2,000	2,461.000	4,922,000
ミライアル	4,100	2,047.000	8,392,700
ダイキョーニシカワ	17,800	597.000	10,626,600
森六ホールディングス	4,500	1,780.000	8,010,000
恵和	2,400	4,305.000	10,332,000
日本化薬	57,400	1,226.000	70,372,400
カーリットホールディングス	8,800	665.000	5,852,000
日本精化	5,500	1,952.000	10,736,000
扶桑化学工業	6,300	3,475.000	21,892,500
トリケミカル研究所	8,700	2,362.000	20,549,400
A D E K A	32,200	2,397.000	77,183,400
日油	23,800	5,400.000	128,520,000
ハリマ化成グループ	7,500	934.000	7,005,000
花王	175,200	6,114.000	1,071,172,800
第一工業製薬	3,300	2,156.000	7,114,800
石原ケミカル	4,600	1,297.000	5,966,200
ニイタカ	2,100	2,387.000	5,012,700
三洋化成工業	4,600	4,625.000	21,275,000
大日本塗料	12,400	736.000	9,126,400
日本ペイントホールディングス	311,600	1,107.000	344,941,200
関西ペイント	72,000	2,194.000	157,968,000
中国塗料	18,900	877.000	16,575,300
日本特殊塗料	5,600	963.000	5,392,800
藤倉化成	12,000	463.000	5,556,000
太陽ホールディングス	12,100	2,711.000	32,803,100
D I C	27,800	2,553.000	70,973,400
サカタインクス	15,400	991.000	15,261,400
東洋インキS Cホールディングス	13,200	1,940.000	25,608,000
T & K T O K A	7,600	1,045.000	7,942,000
富士フイルムホールディングス	148,900	7,161.000	1,066,272,900
資生堂	147,500	5,140.000	758,150,000
ライオン	85,600	1,645.000	140,812,000
高砂香料工業	4,800	2,861.000	13,732,800
マンダム	17,100	1,540.000	26,334,000
ミルボン	10,600	6,370.000	67,522,000

ファンケル	34,400	2,923.000	100,551,200
コーセー	14,400	14,110.000	203,184,000
コタ	6,100	1,577.000	9,619,700
ポーラ・オルビスホールディングス	36,400	1,566.000	57,002,400
ノエビアホールディングス	6,300	5,770.000	36,351,000
新日本製薬	4,600	1,642.000	7,553,200
エステー	6,300	1,553.000	9,783,900
コニシ	12,600	1,651.000	20,802,600
長谷川香料	14,500	3,085.000	44,732,500
小林製薬	21,600	8,380.000	181,008,000
荒川化学工業	6,900	1,042.000	7,189,800
メック	5,900	2,499.000	14,744,100
日本高純度化学	2,500	2,385.000	5,962,500
タカラバイオ	22,200	1,902.000	42,224,400
J C U	8,500	3,200.000	27,200,000
デクセリアルズ	22,100	4,125.000	91,162,500
アース製薬	6,500	5,460.000	35,490,000
北興化学工業	10,200	998.000	10,179,600
大成ラミック	5,200	2,948.000	15,329,600
クミアイ化学工業	28,400	1,020.000	28,968,000
日本農薬	16,100	841.000	13,540,100
アキレス	6,500	1,345.000	8,742,500
有沢製作所	12,600	1,354.000	17,060,400
日東電工	51,000	9,230.000	470,730,000
レック	11,600	788.000	9,140,800
三光合成	12,500	464.000	5,800,000
きもと	35,300	261.000	9,213,300
藤森工業	6,300	3,585.000	22,585,500
前澤化成工業	6,800	1,313.000	8,928,400
未来工業	3,400	1,515.000	5,151,000
J S P	5,400	1,454.000	7,851,600
エフピコ	15,900	3,405.000	54,139,500
天馬	6,500	2,250.000	14,625,000
信越ポリマー	14,700	1,347.000	19,800,900
東リ	29,100	204.000	5,936,400
ニフコ	28,200	3,180.000	89,676,000
バルカー	7,100	2,711.000	19,248,100
ユニ・チャーム	147,200	4,812.000	708,326,400
協和キリン	84,800	3,300.000	279,840,000
武田薬品工業	666,100	3,894.000	2,593,793,400
アステラス製薬	724,500	2,026.500	1,468,199,250
住友ファーマ	52,600	1,059.000	55,703,400
塩野義製薬	98,500	7,050.000	694,425,000
わかもと製薬	9,000	242.000	2,178,000
日本新薬	18,500	7,590.000	140,415,000
中外製薬	220,600	3,664.000	808,278,400
科研製薬	12,300	3,895.000	47,908,500
エーザイ	93,800	5,983.000	561,205,400

ロート製薬	40,400	4,435.000	179,174,000
小野薬品工業	163,400	3,385.000	553,109,000
久光製薬	17,800	3,505.000	62,389,000
持田製薬	9,500	3,445.000	32,727,500
参天製薬	148,100	1,023.000	151,506,300
扶桑薬品工業	3,400	2,022.000	6,874,800
ツムラ	24,200	3,130.000	75,746,000
キッセイ薬品工業	12,000	2,541.000	30,492,000
生化学工業	15,200	893.000	13,573,600
栄研化学	13,000	1,856.000	24,128,000
鳥居薬品	3,600	2,861.000	10,299,600
JCRファーマ	24,100	2,204.000	53,116,400
東和薬品	12,200	2,219.000	27,071,800
富士製薬工業	6,300	1,022.000	6,438,600
ゼリア新薬工業	12,800	2,102.000	26,905,600
第一三共	614,600	4,309.000	2,648,311,400
キョーリン製薬ホールディングス	15,400	1,777.000	27,365,800
大幸薬品	15,300	606.000	9,271,800
ダイト	5,600	2,668.000	14,940,800
大塚ホールディングス	161,300	4,643.000	748,915,900
大正製薬ホールディングス	16,700	5,210.000	87,007,000
ペプチドリーム	34,700	1,701.000	59,024,700
あすか製薬ホールディングス	8,700	1,189.000	10,344,300
サワイグループホールディングス	16,300	4,025.000	65,607,500
日本コークス工業	80,300	98.000	7,869,400
ニチレキ	9,100	1,345.000	12,239,500
ユシロ化学工業	11,700	876.000	10,249,200
富士石油	24,400	337.000	8,222,800
出光興産	85,900	3,445.000	295,925,500
E N E O Sホールディングス	1,274,500	511.700	652,161,650
コスモエネルギーホールディングス	33,500	3,975.000	133,162,500
横浜ゴム	39,900	2,377.000	94,842,300
TOYO TIRE	40,600	1,703.000	69,141,800
ブリヂストン	225,200	5,226.000	1,176,895,200
住友ゴム工業	69,400	1,223.000	84,876,200
藤倉コンポジット	7,900	965.000	7,623,500
オカモト	4,100	3,850.000	15,785,000
フコク	3,500	1,002.000	3,507,000
ニッタ	7,600	2,992.000	22,739,200
住友理工	16,400	585.000	9,594,000
三ツ星ベルト	10,400	3,290.000	34,216,000
バンドー化学	13,600	1,050.000	14,280,000
日東紡績	10,900	2,587.000	28,198,300
A G C	71,800	4,870.000	349,666,000
日本電気硝子	29,200	2,663.000	77,759,600
オハラ	6,000	1,555.000	9,330,000
住友大阪セメント	13,300	3,535.000	47,015,500
太平洋セメント	48,700	2,141.000	104,266,700

日本ヒューム	9,700	669.000	6,489,300
日本コンクリート工業	23,800	273.000	6,497,400
三谷セキサン	4,200	3,810.000	16,002,000
アジアパイルホールディングス	16,100	513.000	8,259,300
東海カーボン	59,900	1,023.000	61,277,700
日本カーボン	4,300	4,075.000	17,522,500
東洋炭素	4,600	3,435.000	15,801,000
ノリタケカンパニーリミテド	4,300	4,160.000	17,888,000
TOTO	51,100	4,915.000	251,156,500
日本碍子	83,000	2,012.000	166,996,000
日本特殊陶業	59,300	2,976.000	176,476,800
MARUWA	2,900	17,490.000	50,721,000
品川リフラクトリーズ	2,200	4,020.000	8,844,000
黒崎播磨	1,700	5,010.000	8,517,000
ヨータイ	5,200	1,437.000	7,472,400
東京窯業	27,100	273.000	7,398,300
フジミインコーポレーテッド	6,800	6,540.000	44,472,000
ニチアス	17,500	2,396.000	41,930,000
ニチハ	10,700	2,859.000	30,591,300
日本製鉄	349,800	2,288.000	800,342,400
神戸製鋼所	145,900	647.000	94,397,300
中山製鋼所	14,100	612.000	8,629,200
合同製鐵	4,700	1,837.000	8,633,900
JFEホールディングス	193,200	1,490.000	287,868,000
東京製鐵	24,400	1,314.000	32,061,600
共英製鋼	8,000	1,513.000	12,104,000
大和工業	13,400	4,795.000	64,253,000
東京鐵鋼	4,400	1,355.000	5,962,000
大阪製鐵	7,100	1,241.000	8,811,100
淀川製鋼所	8,400	2,527.000	21,226,800
丸一鋼管	23,900	2,979.000	71,198,100
モリ工業	3,900	2,731.000	10,650,900
大同特殊鋼	11,300	3,865.000	43,674,500
日本冶金工業	6,300	2,885.000	18,175,500
山陽特殊製鋼	7,000	2,091.000	14,637,000
愛知製鋼	5,000	2,130.000	10,650,000
日立金属	89,900	2,120.000	190,588,000
大平洋金属	5,500	2,411.000	13,260,500
新日本電工	48,400	362.000	17,520,800
栗本鐵工所	3,900	1,645.000	6,415,500
三菱製鋼	7,000	1,025.000	7,175,000
日本精線	1,500	4,655.000	6,982,500
新家工業	6,200	1,696.000	10,515,200
大紀アルミニウム工業所	10,600	1,362.000	14,437,200
日本軽金属ホールディングス	21,900	1,625.000	35,587,500
三井金属鉱業	22,700	3,225.000	73,207,500
東邦亜鉛	4,900	2,515.000	12,323,500
三菱マテリアル	48,900	2,057.000	100,587,300

住友金属鉱山	92,000	4,422.000	406,824,000
DOWAホールディングス	19,500	5,500.000	107,250,000
古河機械金属	12,200	1,272.000	15,518,400
大阪チタニウムテクノロジーズ	10,000	3,390.000	33,900,000
東邦チタニウム	15,200	2,474.000	37,604,800
UACJ	11,300	2,499.000	28,238,700
CKサンエツ	1,600	4,105.000	6,568,000
古河電気工業	24,500	2,495.000	61,127,500
住友電気工業	291,700	1,640.000	478,388,000
フジクラ	93,500	987.000	92,284,500
昭和電線ホールディングス	7,600	1,854.000	14,090,400
タツタ電線	14,900	467.000	6,958,300
平河ヒューテック	4,900	1,131.000	5,541,900
リョービ	8,500	1,340.000	11,390,000
アーレスティ	12,000	401.000	4,812,000
アサヒホールディングス	33,700	2,143.000	72,219,100
稲葉製作所	10,400	1,345.000	13,988,000
宮地エンジニアリンググループ	2,700	3,250.000	8,775,000
トーカロ	21,100	1,296.000	27,345,600
アルファ	8,800	945.000	8,316,000
SUMCO	138,400	1,954.000	270,433,600
川田テクノロジーズ	1,900	3,790.000	7,201,000
RS TECHNOLOGIES	2,400	6,770.000	16,248,000
信和	17,600	811.000	14,273,600
東洋製罐グループホールディングス	42,800	1,788.000	76,526,400
ホッカンホールディングス	5,800	1,336.000	7,748,800
横河ブリッジホールディングス	11,700	1,975.000	23,107,500
三和ホールディングス	78,500	1,392.000	109,272,000
文化シャッター	24,300	1,068.000	25,952,400
三協立山	11,100	625.000	6,937,500
アルインコ	7,500	907.000	6,802,500
LIXIL	131,600	2,380.000	313,208,000
ノーリツ	10,800	1,559.000	16,837,200
長府製作所	7,200	2,036.000	14,659,200
リンナイ	14,500	10,740.000	155,730,000
日東精工	11,200	532.000	5,958,400
岡部	13,500	672.000	9,072,000
ジーテクト	8,300	1,400.000	11,620,000
東プレ	12,300	1,255.000	15,436,500
高周波熱錬	14,300	695.000	9,938,500
東京製網	6,100	976.000	5,953,600
サンコール	8,800	738.000	6,494,400
パイオラックス	11,000	1,982.000	21,802,000
エイチワン	1,400	609.000	852,600
日本発条	70,100	962.000	67,436,200
三益半導体工業	6,300	2,122.000	13,368,600
日本製鋼所	21,700	3,125.000	67,812,500
三浦工業	33,100	2,961.000	98,009,100

タクマ	24,400	1,357.000	33,110,800
ツガミ	17,500	1,235.000	21,612,500
オークマ	8,000	5,310.000	42,480,000
芝浦機械	9,700	3,060.000	29,682,000
アマダ	131,000	1,110.000	145,410,000
アイダエンジニアリング	18,100	849.000	15,366,900
F U J I	33,300	2,051.000	68,298,300
牧野フライス製作所	8,500	4,510.000	38,335,000
オーエスジー	34,200	1,961.000	67,066,200
旭ダイヤモンド工業	21,500	774.000	16,641,000
D M G 森精機	43,300	1,782.000	77,160,600
ソディック	21,300	813.000	17,316,900
ディスコ	12,400	34,900.000	432,760,000
日東工器	4,600	1,645.000	7,567,000
日進工具	6,600	1,126.000	7,431,600
パンチ工業	10,300	440.000	4,532,000
豊和工業	6,800	833.000	5,664,400
東洋機械金属	8,000	578.000	4,624,000
島精機製作所	12,100	2,204.000	26,668,400
オプトラン	10,900	2,365.000	25,778,500
N C ホールディングス	3,300	1,988.000	6,560,400
イワキ	6,400	1,403.000	8,979,200
フリーー	8,600	1,035.000	8,901,000
ヤマシンフィルタ	17,000	333.000	5,661,000
日阪製作所	9,700	851.000	8,254,700
やまびこ	12,200	1,167.000	14,237,400
野村マイクロ・サイエンス	2,800	3,730.000	10,444,000
平田機工	3,800	4,670.000	17,746,000
ベガサスミシン製造	10,400	919.000	9,557,600
マルマエ	4,200	2,034.000	8,542,800
タツモ	5,200	1,443.000	7,503,600
ナブテスコ	44,800	3,355.000	150,304,000
レオン自動機	9,400	1,234.000	11,599,600
S M C	24,800	68,590.000	1,701,032,000
ホソカワミクロン	5,500	2,620.000	14,410,000
ユニオンツール	3,000	3,605.000	10,815,000
オイレス工業	11,000	1,524.000	16,764,000
日精エー・エス・ビー機械	3,400	4,140.000	14,076,000
サトーホールディングス	11,200	1,912.000	21,414,400
技研製作所	7,500	3,480.000	26,100,000
日本エアーテック	5,500	1,075.000	5,912,500
日精樹脂工業	6,800	959.000	6,521,200
オカダアイヨン	4,100	1,470.000	6,027,000
ワイエイシイホールディングス	4,100	1,452.000	5,953,200
小松製作所	384,100	2,895.000	1,111,969,500
住友重機械工業	45,100	2,939.000	132,548,900
日立建機	33,900	2,933.000	99,428,700
日工	13,300	638.000	8,485,400

巴工業	3,600	2,549.000	9,176,400
井関農機	8,200	1,254.000	10,282,800
TOWA	7,700	1,887.000	14,529,900
ローツェ	4,200	8,750.000	36,750,000
クボタ	379,000	2,203.000	834,937,000
荏原実業	3,700	2,188.000	8,095,600
三菱化工機	3,400	2,231.000	7,585,400
月島機械	14,500	905.000	13,122,500
帝国電機製作所	5,800	1,993.000	11,559,400
新東工業	16,900	718.000	12,134,200
澁谷工業	6,600	2,462.000	16,249,200
アイチコーポレーション	12,300	829.000	10,196,700
小森コーポレーション	20,200	754.000	15,230,800
鶴見製作所	6,400	2,330.000	14,912,000
住友精密工業	2,900	2,600.000	7,540,000
酒井重工業	2,100	3,030.000	6,363,000
荏原製作所	29,000	5,330.000	154,570,000
西島製作所	8,400	1,401.000	11,768,400
北越工業	8,200	1,017.000	8,339,400
ダイキン工業	92,500	24,885.000	2,301,862,500
オルガノ	2,400	9,030.000	21,672,000
トーヨーカネツ	3,600	2,541.000	9,147,600
栗田工業	42,700	5,510.000	235,277,000
椿本チエイン	10,800	3,260.000	35,208,000
大同工業	9,900	722.000	7,147,800
木村化工機	10,300	755.000	7,776,500
アネスト岩田	13,900	932.000	12,954,800
ダイフク	39,900	7,990.000	318,801,000
サムコ	2,600	3,350.000	8,710,000
タダノ	41,500	930.000	38,595,000
フジテック	26,100	2,961.000	77,282,100
C K D	21,400	1,915.000	40,981,000
平和	24,100	2,152.000	51,863,200
理想科学工業	7,300	2,492.000	18,191,600
SANKYO	17,800	4,080.000	72,624,000
日本金銭機械	10,500	675.000	7,087,500
マースグループホールディングス	6,200	1,604.000	9,944,800
フクシマガリレイ	5,200	3,660.000	19,032,000
ダイコク電機	5,200	1,299.000	6,754,800
竹内製作所	13,000	2,738.000	35,594,000
アマノ	22,400	2,569.000	57,545,600
JUKI	13,200	714.000	9,424,800
ジャノメ	8,800	692.000	6,089,600
マックス	10,000	2,039.000	20,390,000
グローリー	20,800	2,278.000	47,382,400
新晃工業	8,200	1,582.000	12,972,400
大和冷機工業	12,000	1,116.000	13,392,000
セガサミーホールディングス	76,400	2,036.000	155,550,400

日本ピストンリング	5,200	1,272.000	6,614,400
リケン	3,800	2,428.000	9,226,400
T P R	9,900	1,293.000	12,800,700
ツバキ・ナカシマ	18,700	1,198.000	22,402,600
ホシザキ	45,700	4,055.000	185,313,500
大豊工業	8,300	708.000	5,876,400
日本精工	145,300	778.000	113,043,400
N T N	158,500	282.000	44,697,000
ジェイテクト	71,500	1,042.000	74,503,000
不二越	6,100	3,825.000	23,332,500
日本トムソン	21,200	570.000	12,084,000
T H K	41,100	2,794.000	114,833,400
前澤給装工業	6,600	907.000	5,986,200
イーグル工業	9,900	1,224.000	12,117,600
日本ピラー工業	7,400	2,580.000	19,092,000
キッツ	27,700	816.000	22,603,200
マキタ	95,900	3,208.000	307,647,200
日立造船	67,900	887.000	60,227,300
三菱重工業	124,500	5,210.000	648,645,000
I H I	53,000	3,760.000	199,280,000
スター精密	14,000	1,829.000	25,606,000
日清紡ホールディングス	58,800	1,116.000	65,620,800
イビデン	40,800	4,580.000	186,864,000
コニカミノルタ	171,500	491.000	84,206,500
ブラザー工業	96,100	2,632.000	252,935,200
ミネベアミツミ	134,300	2,457.000	329,975,100
日立製作所	407,500	7,007.000	2,855,352,500
東芝	148,300	5,047.000	748,470,100
三菱電機	790,200	1,390.000	1,098,378,000
富士電機	47,000	5,990.000	281,530,000
安川電機	84,100	4,720.000	396,952,000
シンフォニア テクノロジー	9,500	1,489.000	14,145,500
明電舎	12,300	2,048.000	25,190,400
オリジン	1,500	1,471.000	2,206,500
山洋電気	3,200	5,340.000	17,088,000
デンヨー	6,600	1,573.000	10,381,800
P H C ホールディングス	13,400	1,597.000	21,399,800
東芝テック	9,100	4,165.000	37,901,500
芝浦メカトロニクス	1,500	11,320.000	16,980,000
マブチモーター	17,600	4,030.000	70,928,000
日本電産	188,300	9,444.000	1,778,305,200
トレックス・セミコンダクター	4,000	2,974.000	11,896,000
東光高岳	5,300	1,932.000	10,239,600
ダブル・スコープ	23,600	2,919.000	68,888,400
ダイヘン	7,900	4,085.000	32,271,500
ヤーマン	14,300	1,455.000	20,806,500
J V C ケンウッド	79,900	203.000	16,219,700
ミマキエンジニアリング	9,500	708.000	6,726,000

I - P E X	5,200	1,373.000	7,139,600
日新電機	19,300	1,439.000	27,772,700
大崎電気工業	18,300	526.000	9,625,800
オムロン	70,600	7,378.000	520,886,800
日東工業	10,700	2,635.000	28,194,500
I D E C	10,600	2,988.000	31,672,800
ジーエス・ユアサ コーポレーション	25,700	2,540.000	65,278,000
メルコホールディングス	2,500	3,285.000	8,212,500
日本電気	100,400	5,090.000	511,036,000
富士通	76,200	16,660.000	1,269,492,000
沖電気工業	34,300	747.000	25,622,100
電気興業	4,400	2,402.000	10,568,800
サンケン電気	7,300	4,900.000	35,770,000
アイホン	4,500	2,072.000	9,324,000
ルネサスエレクトロニクス	462,300	1,347.000	622,718,100
セイコーエプソン	94,600	2,164.000	204,714,400
ワコム	64,900	797.000	51,725,300
アルバック	17,000	5,860.000	99,620,000
アクセル	6,500	956.000	6,214,000
E I Z O	5,900	3,845.000	22,685,500
日本信号	18,100	947.000	17,140,700
京三製作所	18,800	430.000	8,084,000
能美防災	9,400	1,629.000	15,312,600
ホーチキ	5,900	1,368.000	8,071,200
エレコム	19,600	1,652.000	32,379,200
パナソニック ホールディングス	903,600	1,151.000	1,040,043,600
シャープ	80,800	979.000	79,103,200
アンリツ	54,600	1,655.000	90,363,000
富士通ゼネラル	23,200	2,920.000	67,744,000
ソニーグループ	530,800	10,760.000	5,711,408,000
T D K	122,600	5,090.000	624,034,000
帝国通信工業	4,600	1,454.000	6,688,400
タムラ製作所	32,200	721.000	23,216,200
アルプスアルパイン	69,100	1,264.000	87,342,400
日本電波工業	9,500	1,609.000	15,285,500
鈴木	3,000	884.000	2,652,000
メイコー	9,300	3,020.000	28,086,000
日本トリム	2,300	2,345.000	5,393,500
ローランド ディー・ジー	4,100	3,270.000	13,407,000
フォスター電機	10,400	786.000	8,174,400
S M K	2,600	2,482.000	6,453,200
ヨコオ	6,100	2,176.000	13,273,600
ホシデン	19,000	1,611.000	30,609,000
ヒロセ電機	11,700	20,550.000	240,435,000
日本航空電子工業	16,800	2,455.000	41,244,000
T O A	10,300	805.000	8,291,500
マクセル	16,000	1,467.000	23,472,000
古野電気	10,700	1,147.000	12,272,900

スミダコーポレーション	7,800	1,056.000	8,236,800
アイコム	3,000	2,602.000	7,806,000
リオン	3,200	2,092.000	6,694,400
横河電機	77,800	2,473.000	192,399,400
新電元工業	3,300	3,745.000	12,358,500
アズビル	49,100	4,070.000	199,837,000
東亜ディーケーケー	9,100	848.000	7,716,800
日本光電工業	32,700	3,205.000	104,803,500
チノー	3,900	1,653.000	6,446,700
共和電業	4,200	341.000	1,432,200
日本電子材料	6,100	1,553.000	9,473,300
堀場製作所	15,700	6,400.000	100,480,000
アドバンテスト	62,900	7,900.000	496,910,000
エスベック	6,800	1,833.000	12,464,400
キーエンス	76,800	54,990.000	4,223,232,000
日置電機	3,700	6,690.000	24,753,000
シスメックス	60,800	8,396.000	510,476,800
日本マイクロニクス	12,200	1,420.000	17,324,000
メガチップス	7,700	2,624.000	20,204,800
O B A R A G R O U P	5,200	3,430.000	17,836,000
コーセル	10,400	919.000	9,557,600
イリソ電子工業	7,300	4,135.000	30,185,500
オブテックスグループ	13,100	2,157.000	28,256,700
千代田インテグレ	5,200	2,213.000	11,507,600
レーザーテック	34,800	19,025.000	662,070,000
スタンレー電気	54,500	2,595.000	141,427,500
岩崎電気	3,300	2,569.000	8,477,700
ウシオ電機	40,200	1,706.000	68,581,200
エノモト	2,500	1,530.000	3,825,000
日本セラミック	7,400	2,658.000	19,669,200
遠藤照明	6,100	782.000	4,770,200
古河電池	6,300	1,192.000	7,509,600
双信電機	8,800	431.000	3,792,800
山一電機	6,400	2,085.000	13,344,000
図研	5,600	3,660.000	20,496,000
日本電子	16,200	5,830.000	94,446,000
カシオ計算機	52,400	1,355.000	71,002,000
ファナック	74,400	23,180.000	1,724,592,000
日本シイエムケイ	18,200	474.000	8,626,800
エンプラス	2,300	4,610.000	10,603,000
大真空	11,700	985.000	11,524,500
ローム	35,200	11,090.000	390,368,000
浜松ホトニクス	56,200	6,330.000	355,746,000
三井ハイテック	7,300	8,650.000	63,145,000
新光電気工業	24,900	3,880.000	96,612,000
京セラ	119,100	8,086.000	963,042,600
太陽誘電	37,700	4,300.000	162,110,000
村田製作所	231,100	7,623.000	1,761,675,300

双葉電子工業	17,100	655.000	11,200,500
北陸電気工業	4,800	1,105.000	5,304,000
ニチコン	22,900	1,546.000	35,403,400
日本ケミコン	7,300	1,959.000	14,300,700
K O A	12,100	2,474.000	29,935,400
市光工業	12,400	391.000	4,848,400
小糸製作所	41,900	4,870.000	204,053,000
ミツバ	14,800	434.000	6,423,200
S C R E E Nホールディングス	13,400	9,360.000	125,424,000
キャノン電子	8,200	1,636.000	13,415,200
キャノン	386,100	3,337.000	1,288,415,700
リコー	202,000	1,124.000	227,048,000
象印マホービン	20,800	1,602.000	33,321,600
東京エレクトロン	53,800	43,450.000	2,337,610,000
トヨタ紡織	29,500	2,057.000	60,681,500
ユニプレス	15,600	970.000	15,132,000
豊田自動織機	59,700	7,800.000	465,660,000
モリタホールディングス	14,200	1,314.000	18,658,800
三櫻工業	12,800	757.000	9,689,600
デンソー	165,700	7,365.000	1,220,380,500
東海理化電機製作所	21,600	1,522.000	32,875,200
川崎重工業	57,800	2,582.000	149,239,600
日本車輛製造	3,500	2,137.000	7,479,500
三菱ロジスネクスト	14,200	836.000	11,871,200
日産自動車	1,000,700	552.900	553,287,030
いすゞ自動車	244,900	1,791.000	438,615,900
トヨタ自動車	3,862,800	2,070.000	7,995,996,000
日野自動車	106,800	650.000	69,420,000
三菱自動車工業	315,400	627.000	197,755,800
エフテック	8,400	529.000	4,443,600
武蔵精密工業	19,000	1,719.000	32,661,000
日産車体	12,700	805.000	10,223,500
新明和工業	23,200	1,069.000	24,800,800
極東開発工業	13,700	1,392.000	19,070,400
トピー工業	7,300	1,418.000	10,351,400
ティラド	2,900	2,778.000	8,056,200
曙ブレーキ工業	57,900	175.000	10,132,500
タチエス	15,000	1,221.000	18,315,000
N O K	32,300	1,270.000	41,021,000
フタバ産業	21,300	352.000	7,497,600
K Y B	7,600	3,495.000	26,562,000
大同メタル工業	20,800	521.000	10,836,800
プレス工業	40,300	442.000	17,812,600
ミクニ	15,200	331.000	5,031,200
太平洋工業	16,500	1,136.000	18,744,000
アイシン	61,700	4,180.000	257,906,000
マツダ	249,700	1,236.000	308,629,200
本田技研工業	619,400	3,714.000	2,300,451,600

スズキ	168,100	5,043.000	847,728,300
S U B A R U	223,200	2,652.500	592,038,000
ヤマハ発動機	110,400	2,925.000	322,920,000
T B K	18,500	313.000	5,790,500
エクセディ	13,200	1,804.000	23,812,800
豊田合成	24,100	2,424.000	58,418,400
愛三工業	14,400	739.000	10,641,600
日本プラスト	21,700	460.000	9,982,000
ヨロズ	8,500	885.000	7,522,500
エフ・シー・シー	13,900	1,454.000	20,210,600
シマノ	28,800	25,270.000	727,776,000
テイ・エス テック	36,000	1,563.000	56,268,000
テルモ	239,700	4,640.000	1,112,208,000
日機装	18,500	1,030.000	19,055,000
日本エム・ディ・エム	5,200	1,281.000	6,661,200
島津製作所	100,900	4,130.000	416,717,000
J M S	4,000	569.000	2,276,000
長野計器	6,400	1,082.000	6,924,800
ブイ・テクノロジー	4,100	2,929.000	12,008,900
東京計器	6,600	1,273.000	8,401,800
愛知時計電機	4,000	1,436.000	5,744,000
インターアクション	4,600	1,706.000	7,847,600
東京精密	13,200	4,695.000	61,974,000
マニー	31,400	1,804.000	56,645,600
ニコン	119,700	1,512.000	180,986,400
トプコン	40,100	1,940.000	77,794,000
オリンパス	406,100	3,177.000	1,290,179,700
理研計器	5,600	4,605.000	25,788,000
タムロン	5,200	3,140.000	16,328,000
H O Y A	163,600	15,260.000	2,496,536,000
ノーリツ鋼機	6,900	2,650.000	18,285,000
A & D ホロンホールディングス	9,500	937.000	8,901,500
朝日インテック	93,100	2,522.000	234,798,200
シチズン時計	83,000	631.000	52,373,000
リズム	3,300	1,454.000	4,798,200
メニコン	26,200	3,330.000	87,246,000
松風	3,400	2,319.000	7,884,600
セイコーホールディングス	12,000	2,964.000	35,568,000
ニプロ	60,300	1,161.000	70,008,300
スノーピーク	12,300	2,203.000	27,096,900
パラマウントベッドホールディングス	16,000	2,671.000	42,736,000
トランザクション	6,200	1,054.000	6,534,800
ニホンフラッシュ	7,200	1,022.000	7,358,400
前田工織	7,700	3,410.000	26,257,000
永大産業	30,800	248.000	7,638,400
アートネイチャー	8,200	735.000	6,027,000
バンダイナムコホールディングス	70,100	10,300.000	722,030,000
S H O E I	7,400	5,570.000	41,218,000

フランスベッドホールディングス	12,500	955.000	11,937,500
パイロットコーポレーション	11,000	5,410.000	59,510,000
萩原工業	5,500	1,083.000	5,956,500
フジシールインターナショナル	17,500	1,564.000	27,370,000
タカラトミー	35,100	1,339.000	46,998,900
広済堂ホールディングス	5,900	1,280.000	7,552,000
プロネクサス	7,000	971.000	6,797,000
ウッドワン	5,900	1,125.000	6,637,500
大建工業	4,700	1,958.000	9,202,600
凸版印刷	109,600	2,297.000	251,751,200
大日本印刷	91,300	3,065.000	279,834,500
共同印刷	2,700	2,496.000	6,739,200
N I S S H A	13,400	1,897.000	25,419,800
T A K A R A & C O M P A N Y	5,800	2,126.000	12,330,800
アシックス	65,000	2,601.000	169,065,000
ローランド	5,300	4,005.000	21,226,500
小松ウオール工業	2,500	1,908.000	4,770,000
ヤマハ	49,000	5,390.000	264,110,000
河合楽器製作所	2,300	2,781.000	6,396,300
クリナップ	8,900	616.000	5,482,400
ピジョン	45,500	2,201.000	100,145,500
キングジム	7,600	917.000	6,969,200
リンテック	16,000	2,356.000	37,696,000
イトーキ	17,000	425.000	7,225,000
任天堂	47,800	58,960.000	2,818,288,000
三菱鉛筆	9,900	1,415.000	14,008,500
タカラスタANDARD	13,000	1,356.000	17,628,000
コクヨ	33,600	1,840.000	61,824,000
ナカバヤシ	7,300	515.000	3,759,500
グローブライド	6,400	2,543.000	16,275,200
オカムラ	23,300	1,359.000	31,664,700
美津濃	7,000	2,731.000	19,117,000
東京電力ホールディングス	635,200	501.000	318,235,200
中部電力	237,900	1,411.000	335,676,900
関西電力	295,500	1,336.000	394,788,000
中国電力	122,900	833.000	102,375,700
北陸電力	73,700	508.000	37,439,600
東北電力	185,400	711.000	131,819,400
四国電力	71,200	812.000	57,814,400
九州電力	161,700	833.000	134,696,100
北海道電力	75,700	510.000	38,607,000
沖縄電力	19,200	1,124.000	21,580,800
電源開発	62,900	2,128.000	133,851,200
エフオン	6,600	730.000	4,818,000
イーレックス	11,100	2,977.000	33,044,700
レノバ	16,700	3,705.000	61,873,500
東京瓦斯	150,900	2,589.000	390,680,100
大阪瓦斯	142,200	2,306.000	327,913,200

東邦瓦斯	33,300	3,075.000	102,397,500
北海道瓦斯	4,900	1,663.000	8,148,700
広島ガス	6,700	331.000	2,217,700
西部ガスホールディングス	7,800	1,822.000	14,211,600
静岡ガス	15,500	1,053.000	16,321,500
メタウォーター	8,600	2,054.000	17,664,400
S B Sホールディングス	6,100	2,899.000	17,683,900
東武鉄道	76,800	3,360.000	258,048,000
相鉄ホールディングス	25,400	2,358.000	59,893,200
東急	196,100	1,690.000	331,409,000
京浜急行電鉄	94,700	1,423.000	134,758,100
小田急電鉄	106,400	1,886.000	200,670,400
京王電鉄	37,200	5,470.000	203,484,000
京成電鉄	52,280	3,930.000	205,460,400
富士急行	8,700	4,225.000	36,757,500
東日本旅客鉄道	129,500	7,215.000	934,342,500
西日本旅客鉄道	90,500	5,527.000	500,193,500
東海旅客鉄道	59,700	16,650.000	994,005,000
西武ホールディングス	102,600	1,439.000	147,641,400
鴻池運輸	12,000	1,382.000	16,584,000
西日本鉄道	20,100	2,859.000	57,465,900
ハマキョウレックス	5,400	3,320.000	17,928,000
サカイ引越センター	3,800	4,820.000	18,316,000
近鉄グループホールディングス	75,100	4,715.000	354,096,500
阪急阪神ホールディングス	92,900	4,300.000	399,470,000
南海電気鉄道	33,800	2,829.000	95,620,200
京阪ホールディングス	31,400	3,585.000	112,569,000
神戸電鉄	2,800	3,385.000	9,478,000
名古屋鉄道	77,900	2,155.000	167,874,500
山陽電気鉄道	6,400	2,202.000	14,092,800
アルプス物流	5,400	1,120.000	6,048,000
ヤマトホールディングス	110,000	2,191.000	241,010,000
山九	19,400	4,360.000	84,584,000
丸全昭和運輸	5,400	3,160.000	17,064,000
センコーグループホールディングス	36,800	985.000	36,248,000
トナミホールディングス	1,600	3,750.000	6,000,000
ニッコンホールディングス	24,000	2,430.000	58,320,000
福山通運	10,100	3,165.000	31,966,500
セイノーホールディングス	43,000	1,154.000	49,622,000
神奈川中央交通	2,300	3,685.000	8,475,500
日立物流	15,500	8,800.000	136,400,000
丸和運輸機関	13,700	1,567.000	21,467,900
C & F ロジホールディングス	7,400	1,214.000	8,983,600
九州旅客鉄道	54,600	3,010.000	164,346,000
S Gホールディングス	134,300	2,187.000	293,714,100
NIPPON EXPRESSホールディングス	26,000	7,610.000	197,860,000
日本郵船	66,800	10,000.000	668,000,000

商船三井	123,300	3,385.000	417,370,500
川崎汽船	24,700	8,060.000	199,082,000
N Sユナイテッド海運	3,800	4,460.000	16,948,000
明治海運	9,900	778.000	7,702,200
飯野海運	32,400	756.000	24,494,400
乾汽船	6,400	1,899.000	12,153,600
日本航空	171,400	2,600.000	445,640,000
A N Aホールディングス	191,700	2,702.000	517,973,400
パスコ	4,000	1,314.000	5,256,000
トランコム	2,300	7,960.000	18,308,000
日新	6,500	1,929.000	12,538,500
三菱倉庫	19,500	3,740.000	72,930,000
三井倉庫ホールディングス	8,200	3,395.000	27,839,000
住友倉庫	23,600	2,192.000	51,731,200
澁澤倉庫	4,400	2,097.000	9,226,800
東陽倉庫	31,000	277.000	8,587,000
日本トランスシティ	14,700	509.000	7,482,300
川西倉庫	3,300	1,042.000	3,438,600
東洋埠頭	2,900	1,229.000	3,564,100
上組	38,100	2,778.000	105,841,800
キューソー流通システム	9,800	1,347.000	13,200,600
エーアイティー	5,500	1,544.000	8,492,000
内外トランスライン	3,100	2,315.000	7,176,500
日本コンセプト	2,900	1,794.000	5,202,600
N E C ネットエイアイ	27,100	1,706.000	46,232,600
クロスキャット	5,500	1,509.000	8,299,500
システナ	116,900	440.000	51,436,000
デジタルアーツ	4,600	6,730.000	30,958,000
日鉄ソリューションズ	14,200	3,730.000	52,966,000
キューブシステム	5,300	1,030.000	5,459,000
コア	3,900	1,452.000	5,662,800
手間いらず	1,200	4,930.000	5,916,000
ラクーンホールディングス	7,800	1,258.000	9,812,400
ソリトンシステムズ	4,900	1,169.000	5,728,100
ソフトクリエイトホールディングス	3,800	3,610.000	13,718,000
T I S	72,400	4,285.000	310,234,000
グリー	39,600	930.000	36,828,000
コーエーテクモホールディングス	26,500	4,690.000	124,285,000
三菱総合研究所	3,500	4,475.000	15,662,500
ファインデックス	8,000	618.000	4,944,000
ブレインパッド	7,700	1,061.000	8,169,700
K L a b	15,700	432.000	6,782,400
ポルトウウィンホールディングス	12,900	950.000	12,255,000
ネクソン	189,800	2,828.000	536,754,400
エムアップホールディングス	10,100	1,817.000	18,351,700
エイチーム	7,000	871.000	6,097,000
エニグモ	11,400	538.000	6,133,200
コロプラ	27,700	707.000	19,583,900

ブロードリーフ	44,100	536.000	23,637,600
デジタルハーツホールディングス	4,400	1,778.000	7,823,200
システム情報	7,000	1,000.000	7,000,000
メディアドゥ	3,300	2,072.000	6,837,600
じげん	27,100	343.000	9,295,300
ブイキューブ	9,300	1,201.000	11,169,300
ディー・エル・イー	8,600	380.000	3,268,000
フィックスターズ	8,800	1,170.000	10,296,000
CARTA HOLDINGS	4,000	1,784.000	7,136,000
オブティム	7,300	912.000	6,657,600
セレス	3,600	1,080.000	3,888,000
SHIFT	5,200	20,720.000	107,744,000
ティーガイア	7,600	1,682.000	12,783,200
テクマトリックス	14,600	1,690.000	24,674,000
プロシップ	3,200	1,449.000	4,636,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	22,000	2,274.000	50,028,000
GMOペイメントゲートウェイ	16,200	11,210.000	181,602,000
システムリサーチ	2,700	1,942.000	5,243,400
インターネットイニシアティブ	22,100	4,855.000	107,295,500
さくらインターネット	11,600	556.000	6,449,600
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2,300	5,290.000	12,167,000
SRAホールディングス	4,400	3,095.000	13,618,000
朝日ネット	9,200	623.000	5,731,600
eBASE	11,400	546.000	6,224,400
アバント	9,100	1,456.000	13,249,600
アドソル日進	3,800	1,533.000	5,825,400
フリービット	5,800	902.000	5,231,600
コムチュア	9,300	2,308.000	21,464,400
アステリア	7,300	841.000	6,139,300
アイル	4,100	1,733.000	7,105,300
マークライنز	4,400	2,369.000	10,423,600
メディカル・データ・ビジョン	11,400	1,073.000	12,232,200
gumi	13,500	946.000	12,771,000
テラスカイ	3,800	2,026.000	7,698,800
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,600	1,578.000	7,258,800
ネオジャパン	3,700	1,103.000	4,081,100
PR TIMES	2,200	2,485.000	5,467,000
ラクス	38,400	1,653.000	63,475,200
ダブルスタンダード	3,000	2,569.000	7,707,000
オーブンドア	5,400	2,039.000	11,010,600
アカツキ	4,200	2,302.000	9,668,400
UBICOMホールディングス	2,600	2,470.000	6,422,000
カナミックネットワーク	13,000	555.000	7,215,000
チェンジ	17,400	1,862.000	32,398,800
オークネット	4,100	2,240.000	9,184,000
エイトレッド	3,000	1,830.000	5,490,000
マクロミル	17,100	1,188.000	20,314,800
オロ	2,800	1,617.000	4,527,600

ユーザーローカル	3,100	1,556.000	4,823,600
マネーフォワード	14,600	3,565.000	52,049,000
電算システムホールディングス	3,800	2,387.000	9,070,600
プロトコーポレーション	9,500	1,097.000	10,421,500
野村総合研究所	144,500	3,710.000	536,095,000
サイバネットシステム	10,800	1,005.000	10,854,000
日本システム技術	1,900	2,793.000	5,306,700
インテージホールディングス	10,100	1,732.000	17,493,200
ソースネクスト	41,100	314.000	12,905,400
インフォコム	9,100	1,962.000	17,854,200
シンプレクス・ホールディングス	13,500	2,095.000	28,282,500
HEROZ	3,300	999.000	3,296,700
ラクスル	10,200	2,375.000	24,225,000
メルカリ	30,200	2,240.000	67,648,000
I P S	2,600	3,170.000	8,242,000
システムサポート	3,700	1,471.000	5,442,700
イーソル	5,600	627.000	3,511,200
アルテリア・ネットワークス	9,400	1,300.000	12,220,000
ウイングアーク1 s t	6,600	1,882.000	12,421,200
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング ス	2,300	1,718.000	3,951,400
サーバーワークス	1,700	2,538.000	4,314,600
S a n s a n	27,100	1,390.000	37,669,000
ギフトィ	8,400	2,309.000	19,395,600
ベース	1,300	6,820.000	8,866,000
J M D C	10,500	5,980.000	62,790,000
フォーカスシステムズ	7,000	1,010.000	7,070,000
クレスコ	6,300	1,793.000	11,295,900
フジ・メディア・ホールディングス	73,800	1,104.000	81,475,200
オービック	26,100	20,850.000	544,185,000
ジャストシステム	11,900	3,400.000	40,460,000
T D C ソフト	6,900	1,183.000	8,162,700
Zホールディングス	1,200,800	415.400	498,812,320
トレンドマイクロ	40,900	8,730.000	357,057,000
日本オラクル	13,900	8,370.000	116,343,000
アルファシステムズ	2,200	4,355.000	9,581,000
フューチャー	17,500	1,701.000	29,767,500
C A C H O L D I N G S	4,500	1,439.000	6,475,500
S B テクノロジー	4,000	2,494.000	9,976,000
オービックビジネスコンサルタント	7,900	5,040.000	39,816,000
伊藤忠テクノソリューションズ	37,800	3,510.000	132,678,000
アイティフォー	11,300	778.000	8,791,400
東計電算	1,500	6,190.000	9,285,000
大塚商会	40,000	4,645.000	185,800,000
サイボウズ	10,600	1,457.000	15,444,200
電通国際情報サービス	8,400	4,645.000	39,018,000
A C C E S S	10,800	734.000	7,927,200
デジタルガレージ	13,800	3,810.000	52,578,000

イーエムシステムズ	12,400	902.000	11,184,800
ウェザーニューズ	2,600	7,990.000	20,774,000
C I J	8,000	779.000	6,232,000
ビジネスエンジニアリング	2,200	2,284.000	5,024,800
WOWOW	4,600	1,359.000	6,251,400
スカラ	10,200	712.000	7,262,400
IMAGICA GROUP	7,000	958.000	6,706,000
ネットワンシステムズ	30,900	3,015.000	93,163,500
アルゴグラフィックス	6,400	3,985.000	25,504,000
マーベラス	14,800	675.000	9,990,000
エイベックス	15,300	1,620.000	24,786,000
B I P R O G Y	26,200	3,145.000	82,399,000
兼松エレクトロニクス	4,400	4,245.000	18,678,000
都築電気	4,400	1,351.000	5,944,400
T B S ホールディングス	40,300	1,624.000	65,447,200
日本テレビホールディングス	69,100	1,174.000	81,123,400
朝日放送グループホールディングス	10,600	644.000	6,826,400
テレビ朝日ホールディングス	19,900	1,439.000	28,636,100
スカパー J S A T ホールディングス	71,200	558.000	39,729,600
テレビ東京ホールディングス	5,400	1,968.000	10,627,200
ビジョン	9,800	1,426.000	13,974,800
USEN - N E X T H O L D I N G S	6,600	2,044.000	13,490,400
コネクシオ	5,700	1,274.000	7,261,800
日本通信	74,900	231.000	17,301,900
日本電信電話	931,900	3,962.000	3,692,187,800
K D D I	606,300	4,428.000	2,684,696,400
ソフトバンク	1,260,000	1,520.000	1,915,200,000
光通信	9,600	17,650.000	169,440,000
エムティーアイ	8,700	507.000	4,410,900
G M O インターネットグループ	26,500	2,709.000	71,788,500
ファイバーゲート	5,500	948.000	5,214,000
K A D O K A W A	45,000	2,974.000	133,830,000
学研ホールディングス	13,100	976.000	12,785,600
ゼンリン	13,600	940.000	12,784,000
アイネット	5,300	1,331.000	7,054,300
松竹	4,900	11,970.000	58,653,000
東宝	49,000	5,370.000	263,130,000
東映	2,300	18,020.000	41,446,000
エヌ・ティ・ティ・データ	220,600	2,041.000	450,244,600
ピー・シー・エー	5,500	1,070.000	5,885,000
ビジネスブレイン太田昭和	3,700	1,543.000	5,709,100
D T S	14,900	3,645.000	54,310,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	38,700	6,250.000	241,875,000
シーイーシー	9,600	1,456.000	13,977,600
カプコン	78,300	3,750.000	293,625,000
アイ・エス・ピー	2,000	1,272.000	2,544,000
ジャステック	5,400	1,213.000	6,550,200
S C S K	57,200	2,333.000	133,447,600

NSW	3,300	2,258.000	7,451,400
アイネス	7,800	1,574.000	12,277,200
TKC	12,200	3,600.000	43,920,000
富士ソフト	7,900	8,610.000	68,019,000
NSD	25,400	2,563.000	65,100,200
コナミグループ	30,200	7,350.000	221,970,000
福井コンピュータホールディングス	3,900	3,625.000	14,137,500
JBC Cホールディングス	6,100	1,888.000	11,516,800
ミロク情報サービス	8,400	1,558.000	13,087,200
ソフトバンクグループ	498,800	5,637.000	2,811,735,600
高千穂交易	3,500	2,229.000	7,801,500
伊藤忠食品	1,700	5,070.000	8,619,000
エレマテック	6,800	1,377.000	9,363,600
あらた	6,200	4,260.000	26,412,000
トーメンデバイス	1,400	5,740.000	8,036,000
東京エレクトロン デバイス	2,500	5,870.000	14,675,000
フィールズ	8,300	1,531.000	12,707,300
双日	85,700	2,364.000	202,594,800
アルフレッサ ホールディングス	86,700	1,697.000	147,129,900
横浜冷凍	23,200	923.000	21,413,600
アルコニックス	11,500	1,389.000	15,973,500
神戸物産	57,600	3,460.000	199,296,000
あい ホールディングス	11,500	2,213.000	25,449,500
ダイワボウホールディングス	35,400	1,999.000	70,764,600
マクニカホールディングス	19,700	2,921.000	57,543,700
ラクト・ジャパン	3,300	2,310.000	7,623,000
グリムス	3,900	1,788.000	6,973,200
バイタルケーエスケー・ホールディングス	14,600	668.000	9,752,800
八洲電機	7,300	1,022.000	7,460,600
メディアスホールディングス	5,900	731.000	4,312,900
レスターホールディングス	7,700	2,035.000	15,669,500
ジューテックホールディングス	5,000	1,096.000	5,480,000
TOKAIホールディングス	40,600	889.000	36,093,400
三洋貿易	7,900	1,073.000	8,476,700
ビューティガレージ	1,800	2,739.000	4,930,200
ウイン・パートナーズ	6,000	971.000	5,826,000
シップヘルスケアホールディングス	24,500	2,700.000	66,150,000
コメダホールディングス	19,400	2,290.000	44,426,000
フルサト・マルカホールディングス	7,500	3,320.000	24,900,000
ヤマエグループホールディングス	5,500	1,663.000	9,146,500
小野建	8,400	1,485.000	12,474,000
伯東	5,100	3,625.000	18,487,500
コンドーテック	7,400	1,030.000	7,622,000
ナガイレーベン	10,200	1,979.000	20,185,800
三菱食品	9,500	3,335.000	31,682,500
松田産業	6,300	2,364.000	14,893,200
第一興商	16,000	4,030.000	64,480,000
メディパルホールディングス	77,400	1,885.000	145,899,000

S P K	4,300	1,420.000	6,106,000
萩原電気ホールディングス	3,500	2,280.000	7,980,000
アズワン	12,000	6,570.000	78,840,000
スズデン	4,400	2,085.000	9,174,000
尾家産業	4,700	866.000	4,070,200
シモジマ	5,800	1,088.000	6,310,400
ドウシシャ	7,600	1,508.000	11,460,800
高速	4,500	1,532.000	6,894,000
丸文	8,400	809.000	6,795,600
ハピネット	6,900	1,604.000	11,067,600
日本ライフライン	25,700	1,017.000	26,136,900
タカショー	8,400	683.000	5,737,200
I D O M	26,300	876.000	23,038,800
進和	5,300	2,205.000	11,686,500
ダイترون	3,400	2,145.000	7,293,000
シークス	11,000	1,145.000	12,595,000
オーハシテクニカ	5,300	1,400.000	7,420,000
白銅	3,100	2,654.000	8,227,400
伊藤忠商事	499,900	3,833.000	1,916,116,700
丸紅	723,100	1,413.500	1,022,101,850
高島	2,000	2,555.000	5,110,000
長瀬産業	37,300	2,066.000	77,061,800
蝶理	4,600	2,048.000	9,420,800
豊田通商	74,000	5,070.000	375,180,000
三共生興	16,200	475.000	7,695,000
兼松	28,400	1,517.000	43,082,800
三井物産	604,800	3,247.000	1,963,785,600
日本紙パルプ商事	4,000	4,425.000	17,700,000
カメイ	9,100	1,139.000	10,364,900
スターゼン	5,900	2,079.000	12,266,100
山善	29,100	937.000	27,266,700
椿本興業	1,500	3,770.000	5,655,000
住友商事	493,800	1,966.000	970,810,800
内田洋行	3,400	4,405.000	14,977,000
三菱商事	547,200	4,416.000	2,416,435,200
第一実業	3,600	3,845.000	13,842,000
キャノンマーケティングジャパン	17,200	3,225.000	55,470,000
西華産業	4,300	1,641.000	7,056,300
佐藤商事	6,100	1,178.000	7,185,800
菱洋エレクトロ	5,600	2,357.000	13,199,200
東京産業	8,000	798.000	6,384,000
ユアサ商事	6,600	3,635.000	23,991,000
神鋼商事	2,000	4,180.000	8,360,000
阪和興業	14,300	3,680.000	52,624,000
正栄食品工業	5,100	3,980.000	20,298,000
カナデン	7,800	1,073.000	8,369,400
菱電商事	7,100	1,629.000	11,565,900
岩谷産業	18,600	5,530.000	102,858,000

ナイス	4,100	1,576.000	6,461,600
極東貿易	5,800	1,346.000	7,806,800
アステナホールディングス	14,000	452.000	6,328,000
三愛オブリ	18,700	1,106.000	20,682,200
稲畑産業	16,600	2,451.000	40,686,600
G S Iクレオス	5,100	1,533.000	7,818,300
明和産業	8,400	796.000	6,686,400
ワキタ	15,800	1,138.000	17,980,400
東邦ホールディングス	23,300	1,867.000	43,501,100
サンゲツ	20,600	1,669.000	34,381,400
ミツウロコグループホールディングス	12,900	1,023.000	13,196,700
シナネンホールディングス	2,900	3,760.000	10,904,000
伊藤忠エネクス	17,700	1,072.000	18,974,400
サンリオ	23,700	3,675.000	87,097,500
サンワ テクノス	4,900	1,400.000	6,860,000
リョーサン	8,700	2,312.000	20,114,400
新光商事	12,600	981.000	12,360,600
トーホー	4,100	1,505.000	6,170,500
三信電気	4,300	1,767.000	7,598,100
東陽テクニカ	9,200	1,313.000	12,079,600
モスフードサービス	11,200	3,100.000	34,720,000
加賀電子	6,700	4,230.000	28,341,000
ソーダニッカ	9,300	608.000	5,654,400
立花エレテック	5,600	1,659.000	9,290,400
P A L T A C	11,700	4,165.000	48,730,500
三谷産業	17,300	310.000	5,363,000
太平洋興発	7,300	710.000	5,183,000
西本W i s m e t t a cホールディングス	2,000	3,715.000	7,430,000
コア商事ホールディングス	5,900	648.000	3,823,200
国際紙パルプ商事	17,100	756.000	12,927,600
ヤマタネ	4,900	1,617.000	7,923,300
日鉄物産	4,800	5,430.000	26,064,000
泉州電業	1,900	5,540.000	10,526,000
トラスコ中山	15,600	1,991.000	31,059,600
オートボックスセブン	27,200	1,436.000	39,059,200
モリト	7,300	710.000	5,183,000
加藤産業	8,800	3,480.000	30,624,000
イノテック	5,800	1,355.000	7,859,000
イエローハット	12,900	1,850.000	23,865,000
J Kホールディングス	6,400	1,050.000	6,720,000
日伝	5,800	1,826.000	10,590,800
杉本商事	4,000	1,908.000	7,632,000
因幡電機産業	20,000	2,779.000	55,580,000
東テク	2,600	3,510.000	9,126,000
ミスミグループ本社	104,700	3,460.000	362,262,000
タキヒヨー	6,000	778.000	4,668,000
スズケン	30,000	3,305.000	99,150,000
ジェコス	4,500	820.000	3,690,000

ローソン	18,700	4,775.000	89,292,500
サンエー	5,300	4,225.000	22,392,500
カワチ薬品	6,600	2,083.000	13,747,800
エービーシー・マート	12,900	6,230.000	80,367,000
ハードオフコーポレーション	5,600	1,378.000	7,716,800
アスクル	18,300	1,842.000	33,708,600
ゲオホールディングス	10,500	1,735.000	18,217,500
アダストリア	9,200	2,191.000	20,157,200
くら寿司	8,900	3,005.000	26,744,500
キャンドゥ	4,700	2,184.000	10,264,800
パルグループホールディングス	7,400	2,459.000	18,196,600
エディオン	37,500	1,183.000	44,362,500
サーラコーポレーション	16,100	827.000	13,314,700
ハローズ	3,700	2,992.000	11,070,400
フジオフードグループ本社	7,100	1,319.000	9,364,900
あみやき亭	1,200	2,908.000	3,489,600
大黒天物産	2,700	5,820.000	15,714,000
ハニーズホールディングス	7,100	1,236.000	8,775,600
アルペン	6,200	2,141.000	13,274,200
クオールホールディングス	10,400	1,234.000	12,833,600
ジンスホールディングス	4,600	4,560.000	20,976,000
ビックカメラ	49,100	1,139.000	55,924,900
D C Mホールディングス	48,900	1,037.000	50,709,300
Monotaro	105,500	2,449.000	258,369,500
アーランドサービスホールディングス	6,100	2,072.000	12,639,200
J . フロント リテイリング	93,000	1,218.000	113,274,000
ドトール・日レスホールディングス	12,800	1,658.000	21,222,400
マツキヨココカラ&カンパニー	48,800	5,730.000	279,624,000
ブロンコビリー	4,600	2,410.000	11,086,000
Z O Z O	57,600	3,055.000	175,968,000
トレジャー・ファクトリー	2,900	1,868.000	5,417,200
物語コーポレーション	4,200	7,120.000	29,904,000
三越伊勢丹ホールディングス	125,400	1,247.000	156,373,800
H a m e e	3,900	1,059.000	4,130,100
ウエルシアホールディングス	44,200	2,994.000	132,334,800
クリエイティブSDホールディングス	11,700	3,130.000	36,621,000
チムニー	9,900	1,238.000	12,256,200
シュッピン	7,500	1,308.000	9,810,000
オイシックス・ラ・大地	12,300	1,770.000	21,771,000
ネクステージ	17,000	3,290.000	55,930,000
ジョイフル本田	23,500	1,763.000	41,430,500
鳥貴族ホールディングス	3,600	2,036.000	7,329,600
ホットランド	7,200	1,312.000	9,446,400
すかいらーくホールディングス	102,300	1,524.000	155,905,200
S F Pホールディングス	4,400	1,687.000	7,422,800
綿半ホールディングス	6,100	1,410.000	8,601,000
ヨシックスホールディングス	2,100	2,150.000	4,515,000

ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	27,800	1,063.000	29,551,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	3,900	2,044.000	7,971,600
B E E N O S	4,500	2,402.000	10,809,000
あさひ	6,700	1,323.000	8,864,100
日本調剤	5,600	1,268.000	7,100,800
コスモス薬品	8,500	14,500.000	123,250,000
セブン&アイ・ホールディングス	279,900	6,023.000	1,685,837,700
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	56,400	903.000	50,929,200
ツルハホールディングス	18,300	7,950.000	145,485,000
サンマルクホールディングス	7,600	1,602.000	12,175,200
フェリシモ	2,500	1,040.000	2,600,000
トリドールホールディングス	20,900	3,090.000	64,581,000
J Mホールディングス	6,900	1,590.000	10,971,000
アレンザホールディングス	6,000	998.000	5,988,000
串カツ田中ホールディングス	3,700	1,780.000	6,586,000
パロックジャパンリミテッド	6,400	793.000	5,075,200
クスリのアオキホールディングス	7,500	6,330.000	47,475,000
FOOD & LIFE COMPANIES	42,800	2,340.000	100,152,000
メディカルシステムネットワーク	9,300	426.000	3,961,800
ノジマ	13,300	2,750.000	36,575,000
カップ・クリエイト	12,100	1,418.000	17,157,800
ライトオン	4,000	692.000	2,768,000
良品計画	96,300	1,297.000	124,901,100
アドヴァングループ	14,000	854.000	11,956,000
アルビス	2,800	2,308.000	6,462,400
G - 7ホールディングス	9,100	1,465.000	13,331,500
イオン北海道	14,500	1,150.000	16,675,000
コジマ	14,200	619.000	8,789,800
コーナン商事	11,800	3,350.000	39,530,000
エコス	3,200	1,830.000	5,856,000
ワタミ	11,000	915.000	10,065,000
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	166,900	2,605.000	434,774,500
西松屋チェーン	16,600	1,565.000	25,979,000
ゼンショーホールディングス	40,500	3,565.000	144,382,500
幸楽苑ホールディングス	6,300	1,020.000	6,426,000
サイゼリヤ	12,800	2,565.000	32,832,000
V Tホールディングス	31,100	494.000	15,363,400
フジ・コーポレーション	4,700	1,267.000	5,954,900
ユナイテッドアローズ	9,100	1,883.000	17,135,300
ハイデイ日高	11,900	2,031.000	24,168,900
コロワイド	34,900	1,884.000	65,751,600
壱番屋	5,600	4,445.000	24,892,000
スギホールディングス	16,700	6,000.000	100,200,000
薬王堂ホールディングス	4,300	2,315.000	9,954,500
スクロール	13,200	748.000	9,873,600
ヨンドシーホールディングス	7,300	1,801.000	13,147,300

木曽路	11,900	2,137.000	25,430,300
S R Sホールディングス	15,600	867.000	13,525,200
千趣会	15,800	392.000	6,193,600
リテールパートナーズ	10,800	1,065.000	11,502,000
ケーヨー	15,900	896.000	14,246,400
上新電機	7,500	1,887.000	14,152,500
日本瓦斯	40,200	2,161.000	86,872,200
ロイヤルホールディングス	14,500	2,146.000	31,117,000
いなげや	8,100	1,207.000	9,776,700
チヨダ	9,600	791.000	7,593,600
ライフコーポレーション	6,500	2,683.000	17,439,500
リンガーハット	10,500	2,149.000	22,564,500
MrMaxHD	11,400	630.000	7,182,000
AOKIホールディングス	15,900	739.000	11,750,100
オークワ	12,300	930.000	11,439,000
コメリ	12,500	2,635.000	32,937,500
青山商事	17,000	1,003.000	17,051,000
しまむら	9,700	12,560.000	121,832,000
高島屋	56,800	1,707.000	96,957,600
松屋	14,600	1,036.000	15,125,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	36,200	1,148.000	41,557,600
近鉄百貨店	5,100	2,336.000	11,913,600
丸井グループ	60,200	2,554.000	153,750,800
アクシアル リテイリング	5,300	3,365.000	17,834,500
イオン	275,300	2,687.500	739,868,750
イズミ	13,200	3,020.000	39,864,000
平和堂	11,700	2,025.000	23,692,500
フジ	18,300	1,939.000	35,483,700
ヤオコー	9,400	6,620.000	62,228,000
ゼビオホールディングス	11,000	986.000	10,846,000
ケーズホールディングス	70,900	1,243.000	88,128,700
OLYMPICグループ	10,200	589.000	6,007,800
Genky DrugStores	3,800	3,660.000	13,908,000
ブックオフグループホールディングス	5,600	1,044.000	5,846,400
ギフトホールディングス	1,900	3,085.000	5,861,500
アインホールディングス	10,300	6,600.000	67,980,000
元気寿司	4,500	2,912.000	13,104,000
ヤマダホールディングス	295,600	484.000	143,070,400
アークランズ	13,500	1,493.000	20,155,500
ニトリホールディングス	33,200	13,000.000	431,600,000
グルメ杵屋	8,900	1,035.000	9,211,500
ケーユーホールディングス	2,000	1,232.000	2,464,000
吉野家ホールディングス	29,600	2,314.000	68,494,400
松屋フーズホールディングス	3,900	3,755.000	14,644,500
サガミホールディングス	13,500	1,224.000	16,524,000
関西フードマーケット	8,100	1,189.000	9,630,900
王将フードサービス	5,200	6,330.000	32,916,000
プレナス	9,100	1,914.000	17,417,400

ミニストップ	7,400	1,415.000	10,471,000
アークス	14,100	2,046.000	28,848,600
パローホールディングス	16,300	1,764.000	28,753,200
ベルク	3,500	5,510.000	19,285,000
大 庄	9,800	1,120.000	10,976,000
ファーストリテイリング	11,200	85,190.000	954,128,000
サンドラッグ	31,400	3,485.000	109,429,000
サックスパー ホールディングス	9,900	650.000	6,435,000
やまや	1,000	2,590.000	2,590,000
ペルーナ	17,500	732.000	12,810,000
めぶきフィナンシャルグループ	345,300	273.000	94,266,900
東京きらぼしフィナンシャルグループ	9,800	2,267.000	22,216,600
九州フィナンシャルグループ	140,100	374.000	52,397,400
ゆうちょ銀行	196,200	1,029.000	201,889,800
富山第一銀行	20,200	427.000	8,625,400
コンコルディア・フィナンシャルグループ	411,600	452.000	186,043,200
西日本フィナンシャルホールディングス	44,300	744.000	32,959,200
三十三フィナンシャルグループ	7,600	1,470.000	11,172,000
第四北越フィナンシャルグループ	11,500	2,632.000	30,268,000
ひろぎんホールディングス	107,200	614.000	65,820,800
おきなわフィナンシャルグループ	7,500	2,150.000	16,125,000
十六フィナンシャルグループ	10,100	2,470.000	24,947,000
北國フィナンシャルホールディングス	7,000	4,710.000	32,970,000
プロクレアホールディングス	9,300	2,159.000	20,078,700
新生銀行	56,000	1,948.000	109,088,000
あおぞら銀行	46,400	2,694.000	125,001,600
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,887,500	725.300	3,544,903,750
りそなホールディングス	882,500	530.000	467,725,000
三井住友トラスト・ホールディングス	137,800	4,312.000	594,193,600
三井住友フィナンシャルグループ	541,500	4,326.000	2,342,529,000
千葉銀行	235,100	754.000	177,265,400
群馬銀行	134,200	392.000	52,606,400
武蔵野銀行	10,500	1,702.000	17,871,000
千葉興業銀行	23,300	265.000	6,174,500
筑波銀行	42,100	190.000	7,999,000
七十七銀行	22,100	1,792.000	39,603,200
秋田銀行	5,800	1,654.000	9,593,200
山形銀行	9,900	943.000	9,335,700
岩手銀行	5,600	1,850.000	10,360,000
東邦銀行	70,200	208.000	14,601,600
ふくおかフィナンシャルグループ	60,400	2,505.000	151,302,000
静岡銀行	170,300	816.000	138,964,800
スルガ銀行	75,300	375.000	28,237,500
八十二銀行	151,600	478.000	72,464,800
山梨中央銀行	10,100	1,156.000	11,675,600
大垣共立銀行	14,400	1,722.000	24,796,800
福井銀行	8,100	1,406.000	11,388,600
清水銀行	1,900	1,470.000	2,793,000

富山銀行	4,100	1,709.000	7,006,900
滋賀銀行	13,400	2,531.000	33,915,400
南都銀行	11,200	1,973.000	22,097,600
百五銀行	71,700	317.000	22,728,900
京都銀行	25,600	5,430.000	139,008,000
紀陽銀行	24,000	1,535.000	36,840,000
ほくほくフィナンシャルグループ	48,800	844.000	41,187,200
山陰合同銀行	46,800	694.000	32,479,200
中国銀行	57,400	937.000	53,783,800
伊予銀行	91,700	644.000	59,054,800
百十四銀行	9,300	1,631.000	15,168,300
四国銀行	13,800	851.000	11,743,800
阿波銀行	10,600	1,887.000	20,002,200
大分銀行	6,000	1,878.000	11,268,000
宮崎銀行	5,700	2,204.000	12,562,800
佐賀銀行	5,400	1,544.000	8,337,600
琉球銀行	21,700	780.000	16,926,000
セブン銀行	249,300	262.000	65,316,600
みずほフィナンシャルグループ	1,000,200	1,637.000	1,637,327,400
山口フィナンシャルグループ	84,500	778.000	65,741,000
名古屋銀行	5,300	3,100.000	16,430,000
北洋銀行	109,600	228.000	24,988,800
愛知銀行	2,800	5,650.000	15,820,000
中京銀行	3,400	1,844.000	6,269,600
愛媛銀行	12,700	860.000	10,922,000
京葉銀行	39,000	493.000	19,227,000
栃木銀行	42,300	282.000	11,928,600
東和銀行	16,400	530.000	8,692,000
トモニホールディングス	65,600	316.000	20,729,600
フィデアホールディングス	9,500	1,317.000	12,511,500
池田泉州ホールディングス	104,100	213.000	22,173,300
F P G	29,200	1,342.000	39,186,400
ジャパンインベストメントアドバイザー	6,000	1,389.000	8,334,000
S B Iホールディングス	102,800	2,727.000	280,335,600
ジャフコ グループ	29,500	2,199.000	64,870,500
大和証券グループ本社	531,600	620.900	330,070,440
野村ホールディングス	1,271,500	507.700	645,540,550
岡三証券グループ	59,100	335.000	19,798,500
丸三証券	29,000	475.000	13,775,000
東洋証券	30,100	255.000	7,675,500
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	81,200	379.000	30,774,800
水戸証券	20,800	260.000	5,408,000
いちよし証券	17,000	644.000	10,948,000
松井証券	42,000	804.000	33,768,000
マネックスグループ	71,500	506.000	36,179,000
極東証券	12,400	695.000	8,618,000
岩井コスモホールディングス	9,100	1,253.000	11,402,300
アイザワ証券グループ	11,700	660.000	7,722,000

スパークス・グループ	40,400	311.000	12,564,400
かんぽ生命保険	84,400	2,203.000	185,933,200
S O M P Oホールディングス	118,800	6,110.000	725,868,000
アニコム ホールディングス	29,100	642.000	18,682,200
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	171,200	4,162.000	712,534,400
第一生命ホールディングス	407,000	2,419.000	984,533,000
東京海上ホールディングス	232,400	7,762.000	1,803,888,800
T & Dホールディングス	186,000	1,505.000	279,930,000
アドバンスクリエイト	7,400	1,076.000	7,962,400
全国保証	20,000	4,750.000	95,000,000
ジェイリース	3,200	2,738.000	8,761,600
日本モーゲージサービス	9,600	908.000	8,716,800
アルヒ	14,400	1,022.000	14,716,800
プレミアグループ	13,200	1,937.000	25,568,400
ネットプロテクションズホールディングス	26,500	508.000	13,462,000
クレディセゾン	49,100	1,786.000	87,692,600
芙蓉総合リース	7,000	8,190.000	57,330,000
みずほリース	10,100	3,320.000	33,532,000
東京センチュリー	12,700	4,910.000	62,357,000
日本証券金融	34,300	836.000	28,674,800
アイフル	143,300	396.000	56,746,800
リコーリース	7,600	3,615.000	27,474,000
イオンフィナンシャルサービス	45,100	1,507.000	67,965,700
アコム	179,700	328.000	58,941,600
ジャックス	8,400	3,845.000	32,298,000
オリエントコーポレーション	228,000	120.000	27,360,000
オリックス	495,400	2,331.500	1,155,025,100
三菱H Cキャピタル	265,400	681.000	180,737,400
日本取引所グループ	194,900	2,095.000	408,315,500
イー・ギャランティ	13,000	2,328.000	30,264,000
N E Cキャピタルソリューション	3,800	2,132.000	8,101,600
いちご	94,800	310.000	29,388,000
日本駐車場開発	95,900	185.000	17,741,500
スター・マイカ・ホールディングス	5,400	1,552.000	8,380,800
S R Eホールディングス	2,600	3,390.000	8,814,000
ヒューリック	161,500	1,090.000	176,035,000
三栄建築設計	4,300	1,647.000	7,082,100
野村不動産ホールディングス	43,100	3,600.000	155,160,000
三重交通グループホールディングス	20,100	488.000	9,808,800
サムティ	10,100	2,263.000	22,856,300
ディア・ライフ	14,000	633.000	8,862,000
地主	7,000	2,000.000	14,000,000
プレサンスコーポレーション	11,400	1,637.000	18,661,800
J P M C	6,400	1,005.000	6,432,000
フージャースホールディングス	12,700	818.000	10,388,600
オープンハウスグループ	26,500	5,410.000	143,365,000
東急不動産ホールディングス	227,200	781.000	177,443,200

飯田グループホールディングス	68,100	2,166.000	147,504,600
And Doホールディングス	6,000	866.000	5,196,000
シーアールイー	4,000	1,783.000	7,132,000
ケイアイスター不動産	3,900	4,980.000	19,422,000
グッドコムアセット	4,200	1,373.000	5,766,600
ジェイ・エス・ピー	2,100	3,590.000	7,539,000
ロードスターキャピタル	3,500	1,817.000	6,359,500
パーク24	54,500	2,000.000	109,000,000
パラカ	4,400	1,960.000	8,624,000
宮越ホールディングス	3,700	946.000	3,500,200
三井不動産	326,200	2,915.000	950,873,000
三菱地所	476,500	1,955.000	931,557,500
平和不動産	13,500	4,035.000	54,472,500
東京建物	66,200	2,142.000	141,800,400
京阪神ビルディング	11,900	1,287.000	15,315,300
住友不動産	150,500	3,552.000	534,576,000
テオーシー	18,400	754.000	13,873,600
東京楽天地	2,100	4,060.000	8,526,000
スターツコーポレーション	11,100	2,707.000	30,047,700
フジ住宅	13,300	657.000	8,738,100
空港施設	12,600	556.000	7,005,600
明和地所	8,800	619.000	5,447,200
ゴールドクレスト	7,600	1,768.000	13,436,800
エスリード	4,100	1,738.000	7,125,800
日神グループホールディングス	17,400	433.000	7,534,200
日本エスコン	16,200	799.000	12,943,800
タカラレーベン	40,700	390.000	15,873,000
イオンモール	42,500	1,668.000	70,890,000
カチタス	20,600	3,590.000	73,954,000
トーセイ	12,200	1,437.000	17,531,400
サンフロンティア不動産	12,500	1,185.000	14,812,500
FJネクストホールディングス	9,400	1,038.000	9,757,200
グランディハウス	9,100	559.000	5,086,900
日本空港ビルデング	27,200	6,180.000	168,096,000
日本工営	5,400	3,865.000	20,871,000
LIFULL	32,400	174.000	5,637,600
ミクシィ	18,900	2,444.000	46,191,600
ジェイエイシーリクルートメント	6,600	2,022.000	13,345,200
日本M&Aセンターホールディングス	133,200	1,757.000	234,032,400
メンバーズ	2,400	2,660.000	6,384,000
UTグループ	11,800	2,764.000	32,615,200
アイティメディア	4,400	1,689.000	7,431,600
E・Jホールディングス	5,200	1,325.000	6,890,000
夢真ビーネックスグループ	26,500	1,695.000	44,917,500
コシダカホールディングス	23,000	874.000	20,102,000
パソナグループ	8,800	2,006.000	17,652,800
リンクアンドモチベーション	22,700	699.000	15,867,300
エス・エム・エス	27,800	3,020.000	83,956,000

パーソルホールディングス	80,800	2,830.000	228,664,000
リニカル	6,400	749.000	4,793,600
クックパッド	43,500	214.000	9,309,000
学情	4,200	1,215.000	5,103,000
スタジオアリス	4,500	2,195.000	9,877,500
シミックホールディングス	5,500	1,657.000	9,113,500
総合警備保障	29,900	3,625.000	108,387,500
カカクコム	59,800	2,601.000	155,539,800
アイロムグループ	3,600	2,582.000	9,295,200
セントケア・ホールディング	4,000	828.000	3,312,000
ルネサンス	8,000	985.000	7,880,000
ディップ	14,300	3,465.000	49,549,500
デジタルホールディングス	6,600	1,267.000	8,362,200
新日本科学	10,400	2,967.000	30,856,800
ベネフィット・ワン	29,700	2,124.000	63,082,800
エムスリー	143,100	4,603.000	658,689,300
アウトソーシング	43,600	1,229.000	53,584,400
ワールドホールディングス	3,600	2,685.000	9,666,000
ディー・エヌ・エー	31,400	1,907.000	59,879,800
博報堂D Yホールディングス	102,400	1,232.000	126,156,800
タカミヤ	14,000	419.000	5,866,000
ジャパンベストレスキューシステム	5,300	735.000	3,895,500
ファンコミュニケーションズ	19,500	419.000	8,170,500
ライク	3,300	2,183.000	7,203,900
エスプール	21,200	1,060.000	22,472,000
WDBホールディングス	3,900	2,650.000	10,335,000
アドウェイズ	10,900	748.000	8,153,200
バリューコマース	5,400	2,469.000	13,332,600
インフォマート	77,000	443.000	34,111,000
J Pホールディングス	29,200	271.000	7,913,200
プレステージ・インターナショナル	31,600	706.000	22,309,600
アミューズ	5,100	1,936.000	9,873,600
ドリームインキュベータ	3,100	1,945.000	6,029,500
クイック	5,500	1,866.000	10,263,000
電通グループ	75,900	4,355.000	330,544,500
ぴあ	2,800	3,375.000	9,450,000
イオンファンタジー	3,600	3,570.000	12,852,000
シーティーエス	10,500	742.000	7,791,000
H . U . グループホールディングス	21,900	2,761.000	60,465,900
アルプス技研	7,000	1,843.000	12,901,000
日本空調サービス	11,100	768.000	8,524,800
オリエンタルランド	86,100	20,170.000	1,736,637,000
ダスキン	17,800	2,845.000	50,641,000
明光ネットワークジャパン	14,500	602.000	8,729,000
ファルコホールディングス	4,500	1,818.000	8,181,000
ラウンドワン	23,200	2,108.000	48,905,600
リゾートトラスト	34,800	2,277.000	79,239,600
ビー・エム・エル	10,300	3,475.000	35,792,500

りらいあコミュニケーションズ	11,600	1,009.000	11,704,400
リソー教育	42,800	322.000	13,781,600
早稲田アカデミー	6,200	1,099.000	6,813,800
ユー・エス・エス	90,900	2,440.000	221,796,000
東京個別指導学院	10,200	564.000	5,752,800
サイバーエージェント	173,700	1,346.000	233,800,200
楽天グループ	335,400	678.000	227,401,200
クリーク・アンド・リバー社	4,600	2,557.000	11,762,200
モーニングスター	17,300	491.000	8,494,300
テー・オー・ダブリュー	20,400	310.000	6,324,000
山田コンサルティンググループ	5,300	1,256.000	6,656,800
セントラルスポーツ	4,000	2,505.000	10,020,000
フルキャストホールディングス	7,000	2,563.000	17,941,000
エン・ジャパン	14,700	2,423.000	35,618,100
テクノプロ・ホールディングス	48,600	3,060.000	148,716,000
アイ・アールジャパンホールディングス	4,100	2,296.000	9,413,600
Keep Per 技研	5,300	4,300.000	22,790,000
Gunosy	5,700	815.000	4,645,500
イー・ガーディアン	3,300	3,035.000	10,015,500
ジャパンマテリアル	24,900	1,957.000	48,729,300
ベクトル	12,000	1,159.000	13,908,000
チャーム・ケア・コーポレーション	6,800	1,156.000	7,860,800
キャリアリンク	3,300	2,346.000	7,741,800
IBJ	6,200	964.000	5,976,800
アサンテ	5,700	1,619.000	9,228,300
バリューHR	7,300	1,457.000	10,636,100
M&Aキャピタルパートナーズ	6,800	3,470.000	23,596,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,600	1,141.000	5,248,600
シグマクス・ホールディングス	10,300	1,239.000	12,761,700
ウィルグループ	6,400	1,417.000	9,068,800
メドピア	5,900	1,540.000	9,086,000
リクルートホールディングス	580,000	4,654.000	2,699,320,000
エラン	9,300	1,101.000	10,239,300
日本郵政	886,300	985.100	873,094,130
ベルシステム24ホールディングス	12,300	1,440.000	17,712,000
鎌倉新書	11,200	736.000	8,243,200
エアトリ	5,200	2,898.000	15,069,600
アトラエ	6,100	1,607.000	9,802,700
ストライク	3,600	4,060.000	14,616,000
ソラスト	20,800	894.000	18,595,200
セラク	3,400	1,109.000	3,770,600
インソース	9,100	2,910.000	26,481,000
ベイカレント・コンサルティング	5,700	41,900.000	238,830,000
Orchestra Holdings	1,800	2,706.000	4,870,800
アイモバイル	5,000	1,335.000	6,675,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	25,700	1,971.000	50,654,700
ウェルビー	7,900	786.000	6,209,400

エル・ティー・エス	1,200	3,300.000	3,960,000	
ミダックホールディングス	3,800	3,650.000	13,870,000	
日総工産	7,900	586.000	4,629,400	
キュービーネットホールディングス	5,200	1,408.000	7,321,600	
R P Aホールディングス	15,000	311.000	4,665,000	
マネジメントソリューションズ	4,200	2,990.000	12,558,000	
フロンティア・マネジメント	3,200	1,288.000	4,121,600	
カーブスホールディングス	23,100	854.000	19,727,400	
フォーラムエンジニアリング	4,700	929.000	4,366,300	
FAST FITNESS JAPAN	2,100	1,584.000	3,326,400	
ダイレクトマーケティングミックス	8,700	1,753.000	15,251,100	
L I T A L I C O	6,800	2,886.000	19,624,800	
リログループ	44,800	2,319.000	103,891,200	
東祥	8,400	1,199.000	10,071,600	
ビーウィズ	3,200	1,406.000	4,499,200	
T R Eホールディングス	15,700	1,737.000	27,270,900	
人・夢・技術グループ	3,700	2,692.000	9,960,400	
エイチ・アイ・エス	16,700	2,111.000	35,253,700	
ラックランド	3,300	2,869.000	9,467,700	
共立メンテナンス	14,600	5,880.000	85,848,000	
イチネンホールディングス	9,100	1,290.000	11,739,000	
建設技術研究所	3,900	2,984.000	11,637,600	
スペース	4,000	863.000	3,452,000	
燦ホールディングス	4,000	1,866.000	7,464,000	
東京テアトル	2,400	1,213.000	2,911,200	
ナガワ	2,200	7,760.000	17,072,000	
東京都競馬	6,400	4,275.000	27,360,000	
カナモト	13,700	2,113.000	28,948,100	
西尾レントオール	6,700	2,907.000	19,476,900	
トランス・コスモス	10,300	3,815.000	39,294,500	
乃村工藝社	34,800	961.000	33,442,800	
日本管財	8,500	2,666.000	22,661,000	
トーカイ	6,900	1,868.000	12,889,200	
セコム	79,900	8,788.000	702,161,200	
セントラル警備保障	4,300	2,370.000	10,191,000	
丹青社	16,600	798.000	13,246,800	
メイテック	29,300	2,391.000	70,056,300	
応用地質	7,300	1,917.000	13,994,100	
船井総研ホールディングス	15,300	2,456.000	37,576,800	
学究社	5,300	1,646.000	8,723,800	
ベネッセホールディングス	27,900	2,140.000	59,706,000	
イオンディライト	9,400	2,850.000	26,790,000	
ダイセキ	14,800	4,485.000	66,378,000	
ステップ	3,600	1,861.000	6,699,600	
合 計	85,629,780		214,676,540,430	

(b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

外国株式インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2021年9月10日現在)	(2022年9月12日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	2,488,240,861	3,391,761,553
金銭信託	125,702,117	59,808,893
コール・ローン	243,549,078	1,681,028,129
株式	314,203,048,109	418,939,787,808
投資証券	7,741,154,753	11,249,570,387
派生商品評価勘定	52,415,131	60,354,105
未収入金	40,874,182	23,211,666
未収配当金	565,016,845	864,034,421
差入委託証拠金	1,576,501,388	2,760,184,509
流動資産合計	327,036,502,464	439,029,741,471
資産合計	327,036,502,464	439,029,741,471
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	8,866,303	128,889,077
前受金	44,342,544	-
未払解約金	39,035,999	162,621,000
未払利息	537	-
その他未払費用	11,928	3,444
流動負債合計	92,257,311	291,513,521
負債合計	92,257,311	291,513,521
純資産の部		
元本等		
元本	59,015,956,817	69,094,291,205
剰余金		
剰余金又は欠損金()	267,928,288,336	369,643,936,745
元本等合計	326,944,245,153	438,738,227,950
純資産合計	326,944,245,153	438,738,227,950
負債純資産合計	327,036,502,464	439,029,741,471

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2021年9月11日 至 2022年9月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	（2021年9月10日現在）	（2022年9月12日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	59,015,956,817口	69,094,291,205口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 5.5399円 （1万口当たりの純資産額55,399円）	1口当たり純資産額 6.3498円 （1万口当たりの純資産額63,498円）

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年9月11日 至 2022年9月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。

<p>2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク</p>	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
<p>4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年9月12日現在)
----	----------------

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年9月10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 SEP21	3,730,567,288	-	3,772,709,909	42,142,621
	SPI 200 FUTURES SEP21	180,267,480	-	178,794,918	1,472,562
	FTSE 100 IDX FUT SEP21	214,307,241	-	213,444,165	863,076
	EURO STOXX 50 SEP21	781,489,951	-	786,025,512	4,535,561
	小計	4,906,631,960	-	4,950,974,504	44,342,544
	合 計	4,906,631,960	-	4,950,974,504	44,342,544

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	182,965,200	-	182,230,152	735,048
	カナダ・ドル	5,204,760	-	5,201,178	3,582
	シンガポール・ドル	818,150	-	817,463	687
	スイス・フラン	4,782,320	-	4,790,552	8,232
	スウェーデン・ク ローナ	2,041,920	-	2,041,456	464
	デンマーク・クロー ネ	1,400,800	-	1,396,800	4,000
	ノルウェー・クロー ネ	379,560	-	379,773	213
	ユーロ	19,530,450	-	19,472,070	58,380

	小計	217,123,160	-	216,329,444	793,716
	合計	217,123,160	-	216,329,444	793,716

(2022年9月12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 SEP22	6,690,495,733	-	6,651,129,185	39,366,548
	SPI 200 FUTURES SEP22	320,502,700	-	319,632,725	869,975
	FTSE 100 IDX FUT SEP22	379,115,789	-	378,834,640	281,149
	EURO STOXX 50 SEP22	1,195,871,658	-	1,176,182,770	19,688,888
	小計	8,585,985,880	-	8,525,779,320	60,206,560
	合計	8,585,985,880	-	8,525,779,320	60,206,560

(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	1,168,388,166	-	1,160,919,696	7,468,470
	カナダ・ドル	56,159,908	-	55,946,420	213,488
	オーストラリア・ドル	26,361,720	-	26,388,720	27,000
	香港・ドル	14,277,130	-	14,186,740	90,390
	シンガポール・ドル	7,176,161	-	7,145,785	30,376
	イギリス・ポンド	71,379,692	-	71,314,681	65,011
	イスラエル・シケル	3,768,601	-	3,769,828	1,227
	スイス・フラン	44,594,262	-	44,654,042	59,780

市場取引以 外の取引	デンマーク・クロー ネ	10,877,972	-	10,830,024	47,948
	ノルウェー・クロー ネ	3,458,721	-	3,467,570	8,849
	スウェーデン・ク ローナ	13,635,679	-	13,623,593	12,086
	ユーロ	119,899,363	-	119,373,306	526,057
	小計	1,539,977,375	-	1,531,620,405	8,356,970
	売建				
	カナダ・ドル	2,193,644	-	2,193,740	96
	オーストラリア・ド ル	5,160,451	-	5,180,379	19,928
	香港・ドル	4,589,255	-	4,547,150	42,105
	イギリス・ボンド	4,974,837	-	4,975,080	243
スイス・フラン	1,488,489	-	1,488,450	39	
ノルウェー・クロー ネ	577,684	-	577,880	196	
ユーロ	2,883,412	-	2,876,534	6,878	
小計	21,867,772	-	21,839,213	28,559	
合 計	1,561,845,147	-	1,553,459,618	8,328,411	

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2021年9月11日 至 2022年9月12日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていな いため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2021年9月10日現在)	
開示対象ファンドの 期首における当該親投資信託の元本額	59,853,159,106円

同期中における追加設定元本額	14,565,827,797円
同期中における一部解約元本額	15,403,030,086円
2021年9月10日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	31,170,342,513円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	270,701,936円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,122,166,488円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	783,254,071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)	65,190,674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)	1,226,514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)	6,216,175円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	18,459,040円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	47,352,076円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	48,992,318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)	95,184,879円
外国株式指数ファンド	705,331,251円
三井住友・DCつみたてN I S A・全海外株インデックスファンド	10,987,662,573円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	81,898,533円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	126,312,173円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	83,678,542円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	15,007,158円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	105,816,051円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	93,324,141円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	314,513,712円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	154,800,475円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	182,268,098円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	35,998,838円
三井住友D S・外国株式インデックス年金ファンド	405,681,734円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	4,206,998円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	17,179,640円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	15,380,398円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,059,243円
S M B C・DCインデックスファンド(M S C Iコクサイ)	82,757,983円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	182,530円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	183,976円
三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド	563,364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)	655,561,055円
バランスファンドV A(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	3,977,147円
S M A M・バランスファンドV A安定成長型 < 適格機関投資家限定 >	32,980,346円
S M A M・バランスファンドV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	777,058,391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 >	898,186,841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 >	3,873,800,818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 >	13,223,432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 >	68,583,205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 >	521,940,125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 >	42,750,063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 >	111,968,960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 >	530,244,129円

SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	378,468,665円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	886,984,440円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	232,559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)	235,317,339円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	82,477,988円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	9,862,293円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	8,314,514円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	4,471,755円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	23,803,987円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	66,591,171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>	149,638,035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>	68,493,967円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	1,099,888,360円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	137,971,492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>	1,044,221,401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>	23,459,810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>	48,604,306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>	52,827,375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>	120,158,753円
合計	59,015,956,817円

(2022年9月12日現在)

開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	59,015,956,817円
同期中における追加設定元本額	20,494,529,737円
同期中における一部解約元本額	10,416,195,349円

2022年9月12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	35,123,557,567円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	275,483,003円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,087,497,791円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	775,204,438円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	32,852,387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)	991,074円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	5,203,753円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	16,441,879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)	48,359,688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)	52,502,521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)	102,719,093円
外国株式指数ファンド	912,210,161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	16,360,503,530円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	87,908,136円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	97,508,641円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	63,989,360円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	18,659,575円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	129,836,552円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	115,457,713円

三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	417,317,703円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	223,443,393円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	259,357,529円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	51,775,463円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	1,286,812,799円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	10,651,413円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	44,388,614円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	39,139,513円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,603,182円
SMBC・DCインデックスファンド(MSCIコクサイ)	297,954,594円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	211,751,353円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	1,158,782,933円
三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド	42,491,244円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	476,572,355円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	3,247,568円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型 <適格機関投資家限定>	21,720,183円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	572,483,865円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	732,038,670円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	3,177,896,398円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	10,511,330円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	52,946,745円
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	427,084,701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>	38,301,233円
SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	93,355,655円
SMAM・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>	440,464,244円
SMAM・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>	302,091,664円
SMAM・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>	713,165,783円
SMAM・バランスVA株40T <適格機関投資家限定>	200,225円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	198,878,953円
SMAM・グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	62,426,977円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	7,719,760円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用>	6,951,628円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用>	3,930,927円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用>	18,307,293円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用>	53,269,072円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA <適格機関投資家限定>	113,544,613円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA <適格機関投資家限定>	50,332,592円
SMAM・世界バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	322,507,095円
SMAM・世界バランスファンドVA2 <適格機関投資家限定>	82,837,181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>	1,673,632,092円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド <適格機関投資家限定>	14,551,834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>	11,351,913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>	14,541,240円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド <適格機関投資家限定>	44,070,821円
合計	69,094,291,205円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	APA CORP	19,759	38.090	752,620.31	
	BAKER HUGHES CO	60,981	25.250	1,539,770.25	
	CHENIERE ENERGY INC	13,763	161.250	2,219,283.75	
	CHEVRON CORP	116,154	159.970	18,581,155.38	
	CONOCOPHILLIPS	80,903	111.970	9,058,708.91	
	COTERRA ENERGY INC	49,908	29.770	1,485,761.16	
	DEVON ENERGY CORP	40,169	68.510	2,751,978.19	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	11,049	135.020	1,491,835.98	
	EOG RESOURCES INC	35,969	123.360	4,437,135.84	
	EQT CORP	19,298	48.350	933,058.30	
	EXXON MOBIL CORP	260,440	96.500	25,132,460.00	
	HALLIBURTON CO	54,852	29.660	1,626,910.32	
	HESS CORP	17,913	122.470	2,193,805.11	
	KINDER MORGAN INC	127,394	18.310	2,332,584.14	
	MARATHON OIL CORP	42,380	26.350	1,116,713.00	
	MARATHON PETROLEUM CORP	34,363	100.010	3,436,643.63	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	58,643	65.610	3,847,567.23	
	ONEOK INC	28,226	62.490	1,763,842.74	
	PHILLIPS 66	29,008	88.030	2,553,574.24	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	13,868	239.620	3,323,050.16	
	SCHLUMBERGER LTD	84,809	39.650	3,362,676.85	
	TARGA RESOURCES CORP	12,350	71.860	887,471.00	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	417	1,822.800	760,107.60	
	VALERO ENERGY CORP	24,663	113.320	2,794,811.16	
	WILLIAMS COS INC	75,529	32.770	2,475,085.33	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	13,678	256.970	3,514,835.66	
	ALBEMARLE CORP	7,433	300.370	2,232,650.21	
	ALCOA CORP	11,849	52.620	623,494.38	
	AMCOR PLC	97,610	12.290	1,199,626.90	
	AVERY DENNISON CORP	5,454	191.050	1,041,986.70	
	BALL CORP	19,410	59.330	1,151,595.30	
	CELANESE CORP	6,643	115.290	765,871.47	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,002	103.680	1,244,367.36	
CLEVELAND-CLIFFS INC	33,403	18.730	625,638.19		
CORTEVA INC	44,440	62.520	2,778,388.80		
CROWN HOLDINGS INC	6,863	98.730	677,583.99		
DOW INC	44,543	50.510	2,249,866.93		
DUPONT DE NEMOURS INC	30,490	58.390	1,780,311.10		
EASTMAN CHEMICAL CO	7,027	93.650	658,078.55		

ECOLAB INC	16,460	172.640	2,841,654.40	
FMC CORP	8,548	112.700	963,359.60	
FREEMPORT-MCMORAN INC	87,567	32.170	2,817,030.39	
INTERNATIONAL PAPER CO	23,472	41.720	979,251.84	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	15,629	114.490	1,789,364.21	
LINDE PLC	31,359	287.030	9,000,973.77	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	17,144	84.130	1,442,324.72	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,559	356.300	1,268,071.70	
MOSAIC CO/THE	21,306	56.240	1,198,249.44	
NEWMONT CORP	50,898	43.170	2,197,266.66	
NUCOR CORP	15,778	143.560	2,265,089.68	
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,550	139.580	774,669.00	
PPG INDUSTRIES INC	15,181	128.110	1,944,837.91	
RPM INTERNATIONAL INC	7,696	95.830	737,507.68	
SEALED AIR CORP	7,895	55.310	436,672.45	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	15,187	240.350	3,650,195.45	
STEEL DYNAMICS INC	12,713	86.520	1,099,928.76	
VULCAN MATERIALS CO	8,762	171.810	1,505,399.22	
WESTLAKE CORP	2,189	100.220	219,381.58	
WESTROCK CO	16,766	40.810	684,220.46	
3M CO	35,101	123.100	4,320,933.10	
AERCAP HOLDINGS NV	8,780	47.100	413,538.00	
ALLEGION PLC	4,764	99.630	474,637.32	
AMETEK INC	14,928	125.780	1,877,643.84	
BOEING CO/THE	35,354	157.520	5,568,962.08	
CARLISLE COS INC	3,499	308.730	1,080,246.27	
CARRIER GLOBAL CORP	50,896	42.170	2,146,284.32	
CATERPILLAR INC	32,639	189.490	6,184,764.11	
CUMMINS INC	9,144	218.470	1,997,689.68	
DEERE & CO	17,769	372.250	6,614,510.25	
DOVER CORP	8,929	129.470	1,156,037.63	
EATON CORP PLC	25,062	145.710	3,651,784.02	
EMERSON ELECTRIC CO	36,697	84.710	3,108,602.87	
FASTENAL CO	37,051	51.200	1,897,011.20	
FORTIVE CORP	21,981	66.020	1,451,185.62	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	7,166	64.690	463,568.54	
GENERAC HOLDINGS INC	3,973	238.000	945,574.00	
GENERAL DYNAMICS CORP	14,867	231.610	3,443,345.87	
GENERAL ELECTRIC CO	67,280	74.040	4,981,411.20	
HEICO CORP	3,085	157.060	484,530.10	
HEICO CORP-CLASS A	4,570	126.500	578,105.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	42,513	191.690	8,149,316.97	
HOWMET AEROSPACE INC	23,889	36.410	869,798.49	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,107	235.300	495,777.10	

IDEX CORP	4,788	210.040	1,005,671.52	
ILLINOIS TOOL WORKS	19,622	206.510	4,052,139.22	
INGERSOLL-RAND INC	25,011	50.230	1,256,302.53	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	11,600	55.610	645,076.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	42,895	58.150	2,494,344.25	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	11,965	236.140	2,825,415.10	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,104	258.210	543,273.84	
LOCKHEED MARTIN CORP	14,923	421.530	6,290,492.19	
MASCO CORP	14,885	52.280	778,187.80	
NORDSON CORP	2,884	234.280	675,663.52	
NORTHROP GRUMMAN CORP	9,085	491.410	4,464,459.85	
OTIS WORLDWIDE CORP	25,348	73.400	1,860,543.20	
OWENS CORNING	5,205	87.530	455,593.65	
PACCAR INC	21,897	88.480	1,937,446.56	
PARKER HANNIFIN CORP	8,047	278.990	2,245,032.53	
PENTAIR PLC	8,220	47.120	387,326.40	
PLUG POWER INC	28,584	29.920	855,233.28	
QUANTA SERVICES INC	8,891	146.760	1,304,843.16	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	93,088	88.040	8,195,467.52	
ROCKWELL AUTOMATION INC	7,031	255.380	1,795,576.78	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,600	41.920	318,592.00	
SMITH (A.O.) CORP	7,157	56.290	402,867.53	
SNAP-ON INC	3,106	223.430	693,973.58	
STANLEY BLACK & DECKER INC	9,129	89.500	817,045.50	
TEXTRON INC	11,803	65.890	777,699.67	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	14,363	163.830	2,353,090.29	
TRANSDIGM GROUP INC	3,374	619.920	2,091,610.08	
UNITED RENTALS INC	4,113	311.140	1,279,718.82	
WABTEC CORP	11,284	91.230	1,029,439.32	
WW GRAINGER INC	2,797	572.740	1,601,953.78	
XYLEM INC	10,225	96.870	990,495.75	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	8,029	97.510	782,907.79	
CINTAS CORP	5,707	431.350	2,461,714.45	
CLARIVATE PLC	19,939	12.310	245,449.09	
COPART INC	13,792	116.110	1,601,389.12	
COSTAR GROUP INC	25,116	78.420	1,969,596.72	
EQUIFAX INC	7,922	197.160	1,561,901.52	
JACOBS SOLUTIONS INC	8,422	125.040	1,053,086.88	
LEIDOS HOLDINGS INC	8,863	95.690	848,100.47	
REPUBLIC SERVICES INC	14,232	147.710	2,102,208.72	
ROBERT HALF INTL INC	5,555	80.470	447,010.85	
ROLLINS INC	11,493	36.120	415,127.16	
TRANSUNION	11,233	76.830	863,031.39	
VERISK ANALYTICS INC	9,674	192.040	1,857,794.96	

WASTE CONNECTIONS INC	16,122	146.400	2,360,260.80
WASTE MANAGEMENT INC	25,212	173.400	4,371,760.80
AMERCO	650	546.730	355,374.50
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,726	114.290	997,294.54
CSX CORP	137,254	32.630	4,478,598.02
DELTA AIR LINES INC	8,299	32.660	271,045.34
EXPEDITORS INTL WASH INC	10,436	103.440	1,079,499.84
FEDEX CORP	15,488	209.070	3,238,076.16
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	96,661	3.150	304,482.15
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,530	174.060	962,551.80
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,940	50.900	404,146.00
LYFT INC-A	18,751	18.110	339,580.61
NORFOLK SOUTHERN CORP	15,062	249.850	3,763,240.70
OLD DOMINION FREIGHT LINE	6,292	268.790	1,691,226.68
SOUTHWEST AIRLINES CO	7,076	38.370	271,506.12
UBER TECHNOLOGIES INC	89,549	31.780	2,845,867.22
UNION PACIFIC CORP	38,617	231.880	8,954,509.96
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	45,848	198.690	9,109,539.12
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	6,249	32.060	200,342.94
APTIV PLC	17,416	96.740	1,684,823.84
BORGWARNER INC	12,075	38.570	465,732.75
FORD MOTOR CO	237,633	15.420	3,664,300.86
GENERAL MOTORS CO	87,113	41.290	3,596,895.77
LEAR CORP	3,736	140.690	525,617.84
LUCID GROUP INC	21,730	15.080	327,688.40
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	19,354	37.550	726,742.70
TESLA INC	163,939	299.680	49,129,239.52
DR HORTON INC	20,992	73.330	1,539,343.36
GARMIN LTD	8,444	90.840	767,052.96
HASBRO INC	7,491	81.450	610,141.95
LENNAR CORP-A	17,126	79.820	1,366,997.32
LULULEMON ATHLETICA INC	7,214	348.650	2,515,161.10
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	113.670	325,437.21
NEWELL BRANDS INC	26,997	18.160	490,265.52
NIKE INC -CL B	79,035	110.970	8,770,513.95
NVR INC	173	4,263.820	737,640.86
PULTEGROUP INC	13,075	41.770	546,142.75
VF CORP	20,583	43.360	892,478.88
WHIRLPOOL CORP	3,212	160.210	514,594.52
AIRBNB INC-CLASS A	23,260	123.480	2,872,144.80
ARAMARK	13,242	37.680	498,958.56
BOOKING HOLDINGS INC	2,502	1,981.030	4,956,537.06
CAESARS ENTERTAINMENT INC	13,336	48.330	644,528.88
CARNIVAL CORP	69,745	10.400	725,348.00

CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,745	1,723.320	3,007,193.40
DARDEN RESTAURANTS INC	7,606	131.040	996,690.24
DOMINO'S PIZZA INC	2,121	367.120	778,661.52
EXPEDIA GROUP INC	10,081	109.170	1,100,542.77
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	17,462	135.910	2,373,260.42
LAS VEGAS SANDS CORP	23,449	38.170	895,048.33
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	16,807	162.360	2,728,784.52
MCDONALD'S CORP	45,922	259.520	11,917,677.44
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,198	35.060	778,261.88
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	11,890	47.240	561,683.60
STARBUCKS CORP	70,068	88.690	6,214,330.92
VAIL RESORTS INC	2,860	234.990	672,071.40
WYNN RESORTS LTD	7,730	62.780	485,289.40
YUM! BRANDS INC	18,046	116.090	2,094,960.14
ADVANCE AUTO PARTS INC	3,426	180.650	618,906.90
AMAZON.COM INC	567,204	133.270	75,591,277.08
AUTOZONE INC	1,212	2,199.080	2,665,284.96
BATH & BODY WORKS INC	15,400	39.650	610,610.00
BEST BUY CO INC	12,132	76.240	924,943.68
BURLINGTON STORES INC	3,391	149.740	507,768.34
CARMAX INC	10,366	91.000	943,306.00
CHEWY INC - CLASS A	3,969	35.980	142,804.62
DOLLAR GENERAL CORP	14,255	247.260	3,524,691.30
DOLLAR TREE INC	13,992	144.450	2,021,144.40
DOORDASH INC - A	11,627	64.310	747,732.37
EBAY INC	35,551	45.100	1,603,350.10
ETSY INC	7,168	110.420	791,490.56
GENUINE PARTS CO	8,711	162.800	1,418,150.80
HOME DEPOT INC	63,655	299.770	19,081,859.35
LKQ CORP	15,922	53.650	854,215.30
LOWE'S COS INC	40,032	205.650	8,232,580.80
MERCADOLIBRE INC	2,889	970.990	2,805,190.11
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,967	721.020	2,860,286.34
POOL CORP	2,578	355.960	917,664.88
ROSS STORES INC	22,258	93.510	2,081,345.58
TARGET CORP	29,311	173.650	5,089,855.15
TJX COMPANIES INC	73,417	66.620	4,891,040.54
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,072	200.920	1,420,906.24
ULTA BEAUTY INC	3,287	442.900	1,455,812.30
WAYFAIR INC- CLASS A	3,756	51.970	195,199.32
COSTCO WHOLESALE CORP	27,292	536.580	14,644,341.36
KROGER CO	41,915	51.940	2,177,065.10
SYSCO CORP	31,126	83.890	2,611,160.14
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	46,212	36.240	1,674,722.88

WALMART INC	94,190	136.840	12,888,959.60	
ALTRIA GROUP INC	111,379	45.570	5,075,541.03	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	34,455	91.470	3,151,598.85	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	18,950	73.480	1,392,446.00	
BUNGE LTD	10,263	96.890	994,382.07	
CAMPBELL SOUP CO	12,945	47.930	620,453.85	
COCA-COLA CO/THE	256,502	62.320	15,985,204.64	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	13,260	49.700	659,022.00	
CONAGRA BRANDS INC	30,896	34.370	1,061,895.52	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	10,439	246.700	2,575,301.30	
GENERAL MILLS INC	37,327	75.910	2,833,492.57	
HERSHEY CO/THE	8,925	226.250	2,019,281.25	
HORMEL FOODS CORP	19,475	46.860	912,598.50	
JM SMUCKER CO/THE	6,647	139.440	926,857.68	
KELLOGG CO	15,843	72.060	1,141,646.58	
KEURIG DR PEPPER INC	46,903	38.690	1,814,677.07	
KRAFT HEINZ CO/THE	44,124	36.460	1,608,761.04	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	15,162	79.890	1,211,292.18	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	9,629	52.170	502,344.93	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	85,090	61.330	5,218,569.70	
MONSTER BEVERAGE CORP	23,823	92.430	2,201,959.89	
PEPSICO INC	86,152	173.220	14,923,249.44	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	96,941	97.060	9,409,093.46	
TYSON FOODS INC-CL A	16,951	75.570	1,280,987.07	
CHURCH & DWIGHT CO INC	14,330	81.560	1,168,754.80	
CLOROX COMPANY	7,384	148.160	1,094,013.44	
COLGATE-PALMOLIVE CO	50,068	78.030	3,906,806.04	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	14,245	252.900	3,602,560.50	
KIMBERLY-CLARK CORP	21,336	126.840	2,706,258.24	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	149,109	139.960	20,869,295.64	
ABBOTT LABORATORIES	108,918	108.480	11,815,424.64	
ABIOMED INC	2,731	282.280	770,906.68	
ALIGN TECHNOLOGY INC	4,914	263.110	1,292,922.54	
AMERISOURCEBERGEN CORP	10,249	147.270	1,509,370.23	
BAXTER INTERNATIONAL INC	30,726	59.530	1,829,118.78	
BECTON DICKINSON AND CO	17,445	262.850	4,585,418.25	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	89,631	42.940	3,848,755.14	
CARDINAL HEALTH INC	18,000	69.890	1,258,020.00	
CENTENE CORP	36,696	91.990	3,375,665.04	
CIGNA CORP	19,571	292.840	5,731,171.64	
COOPER COS INC/THE	2,771	314.700	872,033.70	
CVS HEALTH CORP	82,113	102.150	8,387,842.95	
DAVITA INC	4,138	92.620	383,261.56	
DENTSPLY SIRONA INC	11,864	33.960	402,901.44	

DEXCOM INC	23,299	92.890	2,164,244.11	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	39,084	97.250	3,800,919.00	
ELEVANCE HEALTH INC	15,116	493.600	7,461,257.60	
HCA HEALTHCARE INC	14,575	219.700	3,202,127.50	
HENRY SCHEIN INC	7,559	74.300	561,633.70	
HOLOGIC INC	16,591	69.160	1,147,433.56	
HUMANA INC	8,018	478.500	3,836,613.00	
IDEXX LABORATORIES INC	4,980	374.130	1,863,167.40	
INSULET CORP	4,263	268.910	1,146,363.33	
INTUITIVE SURGICAL INC	22,662	221.320	5,015,553.84	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	5,327	238.320	1,269,530.64	
MASIMO CORP	2,941	156.250	459,531.25	
MCKESSON CORP	8,861	366.210	3,244,986.81	
MEDTRONIC PLC	81,515	89.730	7,314,340.95	
MOLINA HEALTHCARE INC	3,428	348.230	1,193,732.44	
NOVOCURE LTD	6,929	88.890	615,918.81	
QUEST DIAGNOSTICS INC	6,814	130.000	885,820.00	
RESMED INC	8,775	236.030	2,071,163.25	
STERIS PLC	6,271	210.300	1,318,791.30	
STRYKER CORP	21,514	230.000	4,948,220.00	
TELADOC HEALTH INC	7,496	33.460	250,816.16	
TELEFLEX INC	3,067	242.150	742,674.05	
UNITEDHEALTH GROUP INC	58,276	524.340	30,556,437.84	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,203	103.010	432,951.03	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	8,342	179.190	1,494,802.98	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	13,599	114.500	1,557,085.50	
ABBVIE INC	109,052	141.420	15,422,133.84	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	18,024	137.630	2,480,643.12	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,912	223.270	1,766,512.24	
AMGEN INC	33,461	247.690	8,287,955.09	
AVANTOR INC	37,382	25.830	965,577.06	
BIOGEN INC	8,733	211.840	1,849,998.72	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	11,557	92.930	1,073,992.01	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,220	509.380	621,443.60	
BIO-TECHNE CORP	2,551	346.780	884,635.78	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	133,211	70.160	9,346,083.76	
CATALENT INC	10,797	95.970	1,036,188.09	
CHARLES RIVER LABORATORIES	3,467	218.240	756,638.08	
DANAHER CORP	43,000	290.420	12,488,060.00	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	20,811	15.000	312,165.00	
ELI LILLY & CO	49,897	317.700	15,852,276.90	
EXACT SCIENCES CORP	9,771	40.650	397,191.15	
GILEAD SCIENCES INC	79,125	65.280	5,165,280.00	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	13,945	66.090	921,625.05	

ILLUMINA INC	9,281	210.350	1,952,258.35
INCYTE CORP	11,842	72.200	854,992.40
IQVIA HOLDINGS INC	11,280	223.170	2,517,357.60
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,089	152.660	624,226.74
JOHNSON & JOHNSON	163,529	165.710	27,098,390.59
MERCK & CO. INC.	155,959	87.340	13,621,459.06
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,369	1,300.950	1,781,000.55
MODERNA INC	20,549	142.280	2,923,711.72
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,359	106.510	677,297.09
PERKINELMER INC	8,323	141.620	1,178,703.26
PFIZER INC	346,479	47.840	16,575,555.36
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,546	724.320	4,741,398.72
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	20,785	43.630	906,849.55
SEAGEN INC	8,954	155.470	1,392,078.38
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	73,873	9.170	677,415.41
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	24,095	569.400	13,719,693.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	16,159	292.110	4,720,205.49
VIATRIS INC	83,466	9.880	824,644.08
WATERS CORP	3,425	312.280	1,069,559.00
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	4,241	313.510	1,329,595.91
ZOETIS INC	29,434	164.310	4,836,300.54
BANK OF AMERICA CORP	447,882	34.940	15,648,997.08
CITIGROUP INC	120,748	50.670	6,118,301.16
CITIZENS FINANCIAL GROUP	30,366	38.320	1,163,625.12
FIFTH THIRD BANCORP	42,445	35.740	1,516,984.30
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	670	846.250	566,987.50
FIRST REPUBLIC BANK/CA	10,970	155.920	1,710,442.40
HUNTINGTON BANCSHARES INC	88,161	14.140	1,246,596.54
JPMORGAN CHASE & CO	181,762	119.170	21,660,577.54
KEYCORP	62,741	18.660	1,170,747.06
M & T BANK CORP	11,046	187.610	2,072,340.06
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	26,202	164.340	4,306,036.68
REGIONS FINANCIAL CORP	53,059	22.210	1,178,440.39
SIGNATURE BANK	4,335	183.760	796,599.60
SVB FINANCIAL GROUP	3,727	422.970	1,576,409.19
TRUIST FINANCIAL CORP	83,228	48.480	4,034,893.44
US BANCORP	86,383	47.580	4,110,103.14
WEBSTER FINANCIAL CORP	9,600	48.550	466,080.00
WELLS FARGO & CO	235,909	45.330	10,693,754.97
ALLY FINANCIAL INC	20,139	33.870	682,107.93
AMERICAN EXPRESS CO	39,319	158.440	6,229,702.36
AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,131	286.610	2,043,815.91
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	24,207	58.110	1,406,668.77
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	49,681	44.140	2,192,919.34

BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	79,448	285.770	22,703,854.96	
BLACKROCK INC	9,264	695.460	6,442,741.44	
BLACKSTONE INC	42,926	99.670	4,278,434.42	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	24,892	108.320	2,696,301.44	
CARLYLE GROUP INC/THE	10,094	33.070	333,808.58	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	7,323	123.970	907,832.31	
CME GROUP INC	21,983	201.320	4,425,617.56	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	7,252	80.870	586,469.24	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	16,425	102.520	1,683,891.00	
EQUITABLE HOLDINGS INC	22,820	30.560	697,379.20	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,377	453.380	1,077,684.26	
FRANKLIN RESOURCES INC	21,778	26.380	574,503.64	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	5,375	46.420	249,507.50	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	21,390	340.100	7,274,739.00	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	35,337	103.400	3,653,845.80	
INVESCO LTD	18,328	17.580	322,206.24	
KKR & CO INC	33,210	51.500	1,710,315.00	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	4,992	231.260	1,154,449.92	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,653	265.930	705,512.29	
MOODY'S CORP	10,511	299.540	3,148,464.94	
MORGAN STANLEY	81,229	89.460	7,266,746.34	
MSCI INC	5,079	491.260	2,495,109.54	
NASDAQ INC	22,924	63.260	1,450,172.24	
NORTHERN TRUST CORP	13,026	99.100	1,290,876.60	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	11,520	108.420	1,248,998.40	
S&P GLOBAL INC	21,747	369.420	8,033,776.74	
SCHWAB (CHARLES) CORP	91,282	74.540	6,804,160.28	
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,481	56.590	310,169.79	
STATE STREET CORP	24,045	73.000	1,755,285.00	
SYNCHRONY FINANCIAL	32,112	33.420	1,073,183.04	
T ROWE PRICE GROUP INC	13,663	124.390	1,699,540.57	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	5,220	68.000	354,960.00	
AFLAC INC	37,779	61.880	2,337,764.52	
ALLEGHANY CORP	912	841.010	767,001.12	
ALLSTATE CORP	16,419	126.440	2,076,018.36	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,866	131.930	641,971.38	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	50,566	55.040	2,783,152.64	
AON PLC-CLASS A	13,151	292.090	3,841,275.59	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	25,320	46.520	1,177,886.40	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	13,030	188.420	2,455,112.60	
ASSURANT INC	3,114	163.700	509,761.80	
BROWN & BROWN INC	14,273	65.410	933,596.93	
CHUBB LTD	26,038	195.000	5,077,410.00	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	8,520	100.690	857,878.80	

ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,288	222.990	287,211.12	
EVEREST RE GROUP LTD	2,065	282.690	583,754.85	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	13,937	41.770	582,148.49	
GLOBE LIFE INC	6,373	102.750	654,825.75	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	21,767	67.020	1,458,824.34	
LINCOLN NATIONAL CORP	8,677	50.810	440,878.37	
LOEWS CORP	12,727	56.860	723,657.22	
MARKEL CORP	837	1,200.160	1,004,533.92	
MARSH & MCLENNAN COS	30,733	166.760	5,125,035.08	
METLIFE INC	41,426	67.640	2,802,054.64	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	16,409	78.290	1,284,660.61	
PROGRESSIVE CORP	36,619	128.680	4,712,132.92	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	22,933	98.480	2,258,441.84	
TRAVELERS COS INC/THE	15,031	164.150	2,467,338.65	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,823	213.800	1,458,757.40	
WR BERKLEY CORP	14,486	67.630	979,688.18	
CBRE GROUP INC - A	20,793	81.170	1,687,767.81	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	79,100	4.780	378,098.00	
ZILLOW GROUP INC - C	10,672	37.885	404,308.72	
ACCENTURE PLC-CL A	39,035	290.550	11,341,619.25	
ADOBE INC	29,039	394.780	11,464,016.42	
AFFIRM HOLDINGS INC	9,077	26.250	238,271.25	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	10,300	91.690	944,407.00	
ANSYS INC	4,983	258.800	1,289,600.40	
APPLOVIN CORP-CLASS A	8,926	27.730	247,517.98	
AUTODESK INC	13,358	211.680	2,827,621.44	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	25,601	244.300	6,254,324.30	
AVALARA INC	4,319	91.990	397,304.81	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	11,682	38.470	449,406.54	
BILL.COM HOLDINGS INC	6,004	167.390	1,005,009.56	
BLACK KNIGHT INC	10,656	67.740	721,837.44	
BLOCK INC	31,499	74.290	2,340,060.71	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	7,244	172.410	1,248,938.04	
CADENCE DESIGN SYS INC	17,492	174.680	3,055,502.56	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	6,979	63.570	443,655.03	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	6,776	121.670	824,435.92	
CITRIX SYSTEMS INC	8,351	103.680	865,831.68	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	14,179	65.830	933,403.57	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	32,759	65.510	2,146,042.09	
COUPA SOFTWARE INC	3,490	70.190	244,963.10	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	13,021	190.860	2,485,188.06	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,300	153.500	353,050.00	
DATADOG INC - CLASS A	14,023	100.540	1,409,872.42	
DOCUSIGN INC	12,031	64.040	770,465.24	

DROPBOX INC-CLASS A	16,584	22.750	377,286.00	
DYNATRACE INC	9,587	40.730	390,478.51	
EPAM SYSTEMS INC	3,733	432.440	1,614,298.52	
FAIR ISAAC CORP	1,494	451.770	674,944.38	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	38,249	91.480	3,499,018.52	
FISERV INC	37,974	106.460	4,042,712.04	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,371	220.460	963,630.66	
FORTINET INC	43,392	53.590	2,325,377.28	
GARTNER INC	5,357	306.140	1,639,991.98	
GLOBAL PAYMENTS INC	18,157	132.630	2,408,162.91	
GODADDY INC - CLASS A	8,905	78.050	695,035.25	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	4,731	69.480	328,709.88	
HUBSPOT INC	2,561	332.500	851,532.50	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	56,397	129.190	7,285,928.43	
INTUIT INC	16,358	450.030	7,361,590.74	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,971	200.220	995,293.62	
MASTERCARD INC - A	53,491	335.850	17,964,952.35	
MICROSOFT CORP	440,399	264.460	116,467,919.54	
MONGODB INC	4,150	268.640	1,114,856.00	
NORTONLIFELOCK INC	31,347	22.730	712,517.31	
OKTA INC	10,337	64.700	668,803.90	
ORACLE CORP	100,364	75.910	7,618,631.24	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	98,735	7.790	769,145.65	
PALO ALTO NETWORKS INC	6,214	564.770	3,509,480.78	
PAYCHEX INC	20,831	126.830	2,641,995.73	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,007	370.170	1,113,101.19	
PAYPAL HOLDINGS INC	67,541	96.230	6,499,470.43	
PTC INC	7,295	119.970	875,181.15	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,992	45.620	182,115.04	
ROPER TECHNOLOGIES INC	6,685	410.160	2,741,919.60	
SALESFORCE INC	62,120	162.590	10,100,090.80	
SERVICENOW INC	12,197	470.030	5,732,955.91	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	13,250	188.190	2,493,517.50	
SPLUNK INC	9,792	94.450	924,854.40	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	14,487	57.300	830,105.10	
SYNOPSIS INC	9,383	340.180	3,191,908.94	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	28,906	66.880	1,933,233.28	
TWILIO INC - A	10,905	72.190	787,231.95	
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,406	385.190	926,767.14	
UNITY SOFTWARE INC	10,899	41.300	450,128.70	
VERISIGN INC	6,425	190.560	1,224,348.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	101,644	205.200	20,857,348.80	
VMWARE INC-CLASS A	13,809	118.120	1,631,119.08	
WESTERN UNION CO	21,840	14.910	325,634.40	

WIX.COM LTD	3,194	70.700	225,815.80	
WORKDAY INC-CLASS A	12,069	169.960	2,051,247.24	
ZENDESK INC	8,763	76.560	670,895.28	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	13,927	82.620	1,150,648.74	
ZSCALER INC	4,551	188.000	855,588.00	
AMPHENOL CORP-CL A	37,896	75.900	2,876,306.40	
APPLE INC	1,002,446	157.370	157,754,927.02	
ARISTA NETWORKS INC	14,847	124.410	1,847,115.27	
ARROW ELECTRONICS INC	4,130	104.250	430,552.50	
CDW CORP/DE	8,621	175.570	1,513,588.97	
CISCO SYSTEMS INC	256,628	45.770	11,745,863.56	
COGNEX CORP	8,698	45.180	392,975.64	
CORNING INC	51,762	33.640	1,741,273.68	
DELL TECHNOLOGIES -C	18,797	39.790	747,932.63	
F5 INC	3,921	160.200	628,144.20	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	86,138	13.430	1,156,833.34	
HP INC	62,253	28.260	1,759,269.78	
JUNIPER NETWORKS INC	17,460	29.040	507,038.40	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	11,811	172.360	2,035,743.96	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	10,692	250.220	2,675,352.24	
NETAPP INC	13,273	72.450	961,628.85	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	11,800	68.830	812,194.00	
TE CONNECTIVITY LTD	19,805	129.040	2,555,637.20	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,844	387.650	1,102,476.60	
TRIMBLE INC	15,566	63.080	981,903.28	
WESTERN DIGITAL CORP	18,492	43.800	809,949.60	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	3,257	307.840	1,002,634.88	
ADVANCED MICRO DEVICES	101,383	85.450	8,663,177.35	
ANALOG DEVICES INC	31,941	154.180	4,924,663.38	
APPLIED MATERIALS INC	53,908	96.510	5,202,661.08	
BROADCOM INC	25,105	522.400	13,114,852.00	
ENPHASE ENERGY INC	8,302	305.700	2,537,921.40	
ENTEGRIS INC	9,961	103.310	1,029,070.91	
INTEL CORP	254,475	31.460	8,005,783.50	
KLA CORP	9,474	358.670	3,398,039.58	
LAM RESEARCH CORP	8,550	450.780	3,854,169.00	
MARVELL TECHNOLOGY INC	53,345	49.740	2,653,380.30	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	32,867	66.960	2,200,774.32	
MICRON TECHNOLOGY INC	68,578	57.440	3,939,120.32	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,887	447.200	1,291,066.40	
NVIDIA CORP	155,657	143.870	22,394,372.59	
NXP SEMICONDUCTORS NV	16,594	168.140	2,790,115.16	
ON SEMICONDUCTOR	27,891	71.670	1,998,947.97	
QORVO INC	6,042	93.530	565,108.26	

QUALCOMM INC	69,691	132.050	9,202,696.55
SKYWORKS SOLUTIONS INC	10,677	102.640	1,095,887.28
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	3,319	313.000	1,038,847.00
TERADYNE INC	10,642	88.840	945,435.28
TEXAS INSTRUMENTS INC	57,116	170.740	9,751,985.84
AT&T INC	442,727	17.030	7,539,640.81
LIBERTY GLOBAL PLC- C	21,079	20.690	436,124.51
LIBERTY GLOBAL PLC-A	8,432	19.590	165,182.88
LUMEN TECHNOLOGIES INC	49,758	9.970	496,087.26
T-MOBILE US INC	39,441	145.700	5,746,553.70
VERIZON COMMUNICATIONS INC	259,035	42.240	10,941,638.40
AES CORP	41,893	27.430	1,149,124.99
ALLIANT ENERGY CORP	16,641	63.070	1,049,547.87
AMEREN CORPORATION	16,937	95.610	1,619,346.57
AMERICAN ELECTRIC POWER	31,824	104.710	3,332,291.04
AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,721	154.900	1,815,582.90
ATMOS ENERGY CORP	8,726	118.090	1,030,453.34
CENTERPOINT ENERGY INC	37,091	32.850	1,218,439.35
CMS ENERGY CORP	16,996	69.850	1,187,170.60
CONSOLIDATED EDISON INC	22,160	100.850	2,234,836.00
CONSTELLATION ENERGY	20,234	87.510	1,770,677.34
DOMINION ENERGY INC	49,705	83.160	4,133,467.80
DTE ENERGY COMPANY	12,057	135.500	1,633,723.50
DUKE ENERGY CORP	46,960	109.880	5,159,964.80
EDISON INTERNATIONAL	24,655	69.100	1,703,660.50
ENTERGY CORP	12,677	119.940	1,520,479.38
ESSENTIAL UTILITIES INC	13,909	47.810	664,989.29
EVERGY INC	13,333	70.150	935,309.95
EVERSOURCE ENERGY	22,116	91.630	2,026,489.08
EXELON CORP	59,385	45.840	2,722,208.40
FIRSTENERGY CORP	31,966	41.510	1,326,908.66
NEXTERA ENERGY INC	121,355	89.900	10,909,814.50
NISOURCE INC	25,829	30.460	786,751.34
NRG ENERGY INC	13,547	43.290	586,449.63
P G & E CORP	91,894	12.890	1,184,513.66
PPL CORP	47,199	29.850	1,408,890.15
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	29,861	68.000	2,030,548.00
SEMPRA ENERGY	19,900	173.760	3,457,824.00
SOUTHERN CO/THE	64,788	79.520	5,151,941.76
UGI CORP	15,256	39.710	605,815.76
VISTRA CORP	25,777	25.250	650,869.25
WEC ENERGY GROUP INC	19,774	106.440	2,104,744.56
XCEL ENERGY INC	33,565	76.980	2,583,833.70
ACTIVISION BLIZZARD INC	47,754	78.510	3,749,166.54

ALPHABET INC-CL A	372,562	110.650	41,223,985.30		
ALPHABET INC-CL C	349,001	111.780	39,011,331.78		
AMC ENTERTAINMENT HLDGS-APE	27,658	5.530	152,948.74		
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	27,658	9.720	268,835.76		
CABLE ONE INC	388	1,098.210	426,105.48		
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,256	405.910	2,945,282.96		
COMCAST CORP-CLASS A	279,670	35.430	9,908,708.10		
DISH NETWORK CORP-A	12,937	19.330	250,072.21		
ELECTRONIC ARTS INC	16,640	128.930	2,145,395.20		
FOX CORP - CLASS A	16,962	34.520	585,528.24		
FOX CORP - CLASS B	8,773	31.970	280,472.81		
IAC INC	3,974	69.010	274,245.74		
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	26,027	28.550	743,070.85		
LIBERTY BROADBAND-C	8,196	98.930	810,830.28		
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	13,438	65.470	879,785.86		
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	4,141	42.570	176,282.37		
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	12,383	42.330	524,172.39		
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	11,080	93.120	1,031,769.60		
MATCH GROUP INC	17,799	62.250	1,107,987.75		
META PLATFORMS INC-CLASS A	142,089	169.150	24,034,354.35		
NETFLIX INC	27,620	233.570	6,451,203.40		
NEWS CORP - CLASS A	23,102	17.470	403,591.94		
OMNICOM GROUP	12,545	70.410	883,293.45		
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	40,964	23.660	969,208.24		
PINTEREST INC- CLASS A	38,300	25.550	978,565.00		
ROBLOX CORP -CLASS A	22,745	45.530	1,035,579.85		
ROKU INC	6,012	71.550	430,158.60		
SEA LTD-ADR	22,722	63.470	1,442,165.34		
SIRIUS XM HOLDINGS INC	56,550	6.270	354,568.50		
SNAP INC - A	64,099	12.650	810,852.35		
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	10,772	127.780	1,376,446.16		
TWITTER INC	42,474	42.190	1,791,978.06		
WALT DISNEY CO/THE	113,298	115.180	13,049,663.64		
WARNER BROS DISCOVERY INC	136,145	13.030	1,773,969.35		
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	15,382	45.210	695,420.22		
アメリカ・ドル小計	21,145,313		2,186,230,017.83 (312,237,371,146)		
カナダ・ドル	ARC RESOURCES LTD	44,923	18.150	815,352.45	
	CAMECO CORP	26,627	39.360	1,048,038.72	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	72,331	71.900	5,200,598.90	
	CENOVUS ENERGY INC	85,669	24.000	2,056,056.00	
	ENBRIDGE INC	127,550	54.470	6,947,648.50	
	IMPERIAL OIL LTD	12,999	63.100	820,236.90	
	KEYERA CORP	11,374	30.900	351,456.60	

PARKLAND CORP	7,666	32.110	246,155.26
PEMBINA PIPELINE CORP	32,172	46.780	1,505,006.16
SUNCOR ENERGY INC	88,397	41.240	3,645,492.28
TC ENERGY CORP	61,897	63.260	3,915,604.22
TOURMALINE OIL CORP	20,401	77.790	1,586,993.79
AGNICO EAGLE MINES LTD	27,243	57.410	1,564,020.63
BARRICK GOLD CORP	114,792	20.730	2,379,638.16
CCL INDUSTRIES INC - CL B	8,705	69.040	600,993.20
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	41,452	23.820	987,386.64
FRANCO-NEVADA CORP	11,502	164.040	1,886,788.08
IVANHOE MINES LTD-CL A	32,698	9.130	298,532.74
KINROSS GOLD CORP	63,501	4.620	293,374.62
LUNDIN MINING CORP	46,446	7.200	334,411.20
NUTRIEN LTD	34,081	123.800	4,219,227.80
PAN AMERICAN SILVER CORP	11,763	20.680	243,258.84
TECK RESOURCES LTD-CLS B	29,836	44.980	1,342,023.28
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,438	111.180	493,416.84
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	26,168	43.060	1,126,794.08
CAE INC	17,963	24.530	440,632.39
TOROMONT INDUSTRIES LTD	6,027	104.770	631,448.79
WSP GLOBAL INC	7,668	165.140	1,266,293.52
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	9,913	39.650	393,050.45
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	5,667	89.230	505,666.41
THOMSON REUTERS CORP	11,370	147.300	1,674,801.00
AIR CANADA	12,083	18.810	227,281.23
CANADIAN NATL RAILWAY CO	36,438	158.880	5,789,269.44
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	58,152	102.000	5,931,504.00
TFI INTERNATIONAL INC	5,097	136.200	694,211.40
MAGNA INTERNATIONAL INC	16,331	75.530	1,233,480.43
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,082	92.500	285,085.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	11,302	41.510	469,146.02
RESTAURANT BRANDS INTERN	19,270	79.270	1,527,532.90
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	3,001	160.510	481,690.51
DOLLARAMA INC	17,025	80.590	1,372,044.75
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	52,906	59.420	3,143,674.52
EMPIRE CO LTD 'A'	9,148	37.880	346,526.24
LOBLAW COMPANIES LTD	9,797	117.460	1,150,755.62
METRO INC/CN	14,765	72.180	1,065,737.70
WESTON (GEORGE) LTD	4,984	153.000	762,552.00
SAPUTO INC	13,425	34.700	465,847.50
BANK OF MONTREAL	42,503	127.440	5,416,582.32
BANK OF NOVA SCOTIA	74,287	73.330	5,447,465.71
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	54,574	63.800	3,481,821.20
NATIONAL BANK OF CANADA	19,626	91.580	1,797,349.08

ROYAL BANK OF CANADA	87,727	127.680	11,200,983.36		
TORONTO-DOMINION BANK	113,800	88.070	10,022,366.00		
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	88,140	65.470	5,770,525.80		
IGM FINANCIAL INC	4,949	36.900	182,618.10		
ONEX CORPORATION	4,217	68.540	289,033.18		
TMX GROUP LTD	3,142	132.310	415,718.02		
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,393	653.820	910,771.26		
GREAT-WEST LIFECO INC	14,200	32.180	456,956.00		
IA FINANCIAL CORP INC	8,268	71.800	593,642.40		
INTACT FINANCIAL CORP	11,416	201.210	2,297,013.36		
MANULIFE FINANCIAL CORP	121,416	23.150	2,810,780.40		
POWER CORP OF CANADA	31,768	34.590	1,098,855.12		
SUN LIFE FINANCIAL INC	37,083	59.360	2,201,246.88		
FIRSTSERVICE CORP	2,516	168.780	424,650.48		
BLACKBERRY LTD	48,654	7.860	382,420.44		
CGI INC	13,476	105.010	1,415,114.76		
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,234	2,033.260	2,509,042.84		
LIGHTSPEED COMMERCE INC	6,363	26.170	166,519.71		
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	5,042	41.640	209,948.88		
OPEN TEXT CORP	15,337	40.080	614,706.96		
SHOPIFY INC - CLASS A	70,950	45.310	3,214,744.50		
BCE INC	5,509	63.710	350,978.39		
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	22,595	54.500	1,231,427.50		
TELUS CORP	15,222	29.330	446,461.26		
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	44,154	17.910	790,798.14		
ALTAGAS LTD	17,347	29.140	505,491.58		
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	6,336	51.880	328,711.68		
CANADIAN UTILITIES LTD-A	7,344	41.020	301,250.88		
EMERA INC	18,000	62.480	1,124,640.00		
FORTIS INC	30,171	58.440	1,763,193.24		
HYDRO ONE LTD	18,821	35.480	667,769.08		
NORTHLAND POWER INC	15,741	44.690	703,465.29		
QUEBECOR INC -CL B	9,953	27.890	277,589.17		
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	31,175	34.420	1,073,043.50		
カナダ・ドル小計	2,514,494		146,662,434.18 (16,091,802,278)		
オーストラ リア・ドル	AMPOL LTD	14,428	32.800	473,238.40	
	SANTOS LTD	199,921	7.850	1,569,379.85	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,722	25.620	325,937.64	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	119,490	32.520	3,885,814.80	
	BHP GROUP LTD	312,138	38.090	11,889,336.42	
	BLUESCOPE STEEL LTD	37,214	16.530	615,147.42	
	EVOLUTION MINING LTD	84,420	2.280	192,477.60	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	105,200	17.810	1,873,612.00	

JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	26,108	34.050	888,977.40	
MINERAL RESOURCES LTD	11,662	71.510	833,949.62	
NEWCREST MINING LTD	54,082	17.650	954,547.30	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	65,844	7.720	508,315.68	
ORICA LTD	36,212	14.680	531,592.16	
RIO TINTO LTD	22,751	94.360	2,146,784.36	
SOUTH32 LTD	276,348	4.250	1,174,479.00	
REECE LTD	13,059	15.360	200,586.24	
BRAMBLES LTD	86,089	11.840	1,019,293.76	
AURIZON HOLDINGS LTD	130,251	3.720	484,533.72	
QANTAS AIRWAYS LTD	45,831	5.240	240,154.44	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	37,719	34.640	1,306,586.16	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,794	60.820	230,751.08	
IDP EDUCATION LTD	10,940	28.160	308,070.40	
LOTTERY CORP LTD/THE	139,785	4.360	609,462.60	
WESFARMERS LTD	69,354	47.280	3,279,057.12	
COLES GROUP LTD	84,799	17.240	1,461,934.76	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	89,318	7.350	656,487.30	
WOOLWORTHS GROUP LTD	74,760	35.970	2,689,117.20	
TREASURY WINE ESTATES LTD	36,464	13.310	485,335.84	
COCHLEAR LTD	4,095	215.000	880,425.00	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	10,781	70.150	756,287.15	
SONIC HEALTHCARE LTD	31,126	32.550	1,013,151.30	
CSL LTD	30,041	298.640	8,971,444.24	
AUST AND NZ BANKING GROUP	183,288	23.020	4,219,289.76	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	107,036	95.530	10,225,149.08	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	198,227	29.850	5,917,075.95	
WESTPAC BANKING CORP	214,582	21.250	4,559,867.50	
ASX LTD	11,180	74.400	831,792.00	
MACQUARIE GROUP LTD	22,604	177.830	4,019,669.32	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	173,755	4.650	807,960.75	
MEDIBANK PRIVATE LTD	128,724	3.540	455,682.96	
QBE INSURANCE GROUP LTD	80,863	12.300	994,614.90	
SUNCORP GROUP LTD	88,234	10.880	959,985.92	
COMPUTERSHARE LTD	28,738	24.620	707,529.56	
WISETECH GLOBAL LTD	10,621	60.460	642,145.66	
XERO LTD	8,683	88.410	767,664.03	
TELSTRA CORP LTD	273,343	3.920	1,071,504.56	
ORIGIN ENERGY LTD	110,998	5.860	650,448.28	
REA GROUP LTD	2,833	124.050	351,433.65	
SEEK LTD	21,957	20.720	454,949.04	
オーストラリア・ドル小計	3,942,412		90,093,030.88 (8,806,593,769)	
香港・ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	173,424	47.850	8,298,338.40

TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	83,000	96.450	8,005,350.00		
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	94,000	14.260	1,340,440.00		
MTR CORP	84,500	40.100	3,388,450.00		
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	70,000	17.400	1,218,000.00		
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	149,000	42.350	6,310,150.00		
SANDS CHINA LTD	142,400	17.280	2,460,672.00		
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	117,000	14.760	1,726,920.00		
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	89,600	21.400	1,917,440.00		
WH GROUP LTD	561,000	5.200	2,917,200.00		
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	247,000	26.650	6,582,550.00		
HANG SENG BANK LTD	48,200	121.800	5,870,760.00		
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	73,800	311.000	22,951,800.00		
AIA GROUP LTD	733,800	74.750	54,851,550.00		
CK ASSET HOLDINGS LTD	126,924	53.300	6,765,049.20		
ESR GROUP LTD	157,000	22.550	3,540,350.00		
HANG LUNG PROPERTIES LTD	98,000	13.320	1,305,360.00		
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	83,384	25.400	2,117,953.60		
NEW WORLD DEVELOPMENT	84,833	26.250	2,226,866.25		
SINO LAND CO	248,200	11.640	2,889,048.00		
SUN HUNG KAI PROPERTIES	89,000	95.500	8,499,500.00		
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	27,000	55.250	1,491,750.00		
SWIRE PROPERTIES LTD	53,000	18.280	968,840.00		
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	91,000	37.350	3,398,850.00		
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	41,000	45.000	1,845,000.00		
CLP HOLDINGS LTD	94,100	65.600	6,172,960.00		
HONG KONG & CHINA GAS	606,389	7.360	4,463,023.04		
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	91,500	43.950	4,021,425.00		
香港・ドル小計	4,558,054		177,545,595.49 (3,229,554,382)		
シンガポ ール・ドル	KEPPEL CORP LTD	70,500	7.400	521,700.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	108,600	3.740	406,164.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	77,966	5.400	421,016.40	
	GENTING SINGAPORE LTD	327,500	0.770	252,175.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	130,000	4.000	520,000.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	109,800	33.370	3,664,026.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	211,400	12.150	2,568,510.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	75,600	27.330	2,066,148.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	65,200	9.570	623,964.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	176,200	3.650	643,130.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	25,800	8.420	217,236.00	
	UOL GROUP LTD	30,900	7.090	219,081.00	
	VENTURE CORP LTD	15,700	17.520	275,064.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	480,715	2.720	1,307,544.80	
シンガポール・ドル小計		1,905,881		13,705,759.20	

				(1,399,358,014)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	94,638	7.695	728,239.41	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	31,250	20.200	631,250.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	99,068	5.450	539,920.60	
	MERCURY NZ LTD	62,522	6.155	384,822.91	
	MERIDIAN ENERGY LTD	66,454	4.950	328,947.30	
ニュージーランド・ドル小計		353,932		2,613,180.22 (228,026,106)	
イギリス・ポンド	BP PLC	1,196,677	4.508	5,394,619.91	
	SHELL PLC	463,201	23.000	10,653,623.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	80,377	29.265	2,352,232.90	
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	11.955	232,393.24	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,838	68.660	538,157.08	
	GLENCORE PLC	622,741	4.884	3,041,467.04	
	JOHNSON MATTHEY PLC	10,074	20.080	202,285.92	
	MONDI PLC	33,905	14.675	497,555.87	
	RIO TINTO PLC	68,899	48.600	3,348,491.40	
	ASHTREAD GROUP PLC	26,131	42.920	1,121,542.52	
	BAE SYSTEMS PLC	187,435	7.844	1,470,240.14	
	BUNZL PLC	22,658	28.990	656,855.42	
	DCC PLC	5,954	49.380	294,008.52	
	FERGUSON PLC	13,361	101.350	1,354,137.35	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	305,227	1.273	388,553.97	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	494,144	0.784	387,408.89	
	SMITHS GROUP PLC	24,369	15.370	374,551.53	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	4,459	108.650	484,470.35	
	EXPERIAN PLC	54,749	27.300	1,494,647.70	
	INTERTEK GROUP PLC	11,884	40.000	475,360.00	
	RELX PLC	121,421	22.910	2,781,755.11	
	RENTOKIL INITIAL PLC	112,603	5.526	622,244.17	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,766	4.222	273,442.05	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,637	35.420	235,082.54	
	BURBERRY GROUP PLC	26,233	17.115	448,977.79	
	PERSIMMON PLC	16,916	15.020	254,078.32	
	TAYLOR WIMPEY PLC	225,588	1.083	244,311.80	
	COMPASS GROUP PLC	110,016	19.000	2,090,304.00	
	ENTAIN PLC	42,158	12.185	513,695.23	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	11,820	47.930	566,532.60	
WHITBREAD PLC	11,282	26.020	293,557.64		
JD SPORTS FASHION PLC	144,300	1.261	181,962.30		
KINGFISHER PLC	109,678	2.421	265,530.43		
NEXT PLC	9,030	58.820	531,144.60		
OCADO GROUP PLC	27,379	7.568	207,204.27		
SAINSBURY (J) PLC	113,480	2.026	229,910.48		

TESCO PLC	495,919	2.399	1,189,709.68
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	24,258	13.550	328,695.90
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	132,652	34.890	4,628,228.28
COCA-COLA HBC AG-DI	8,704	19.680	171,294.72
DIAGEO PLC	140,860	37.970	5,348,454.20
IMPERIAL BRANDS PLC	59,422	19.525	1,160,214.55
HALEON PLC	293,573	2.610	766,225.53
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	44,920	65.680	2,950,345.60
UNILEVER PLC	158,053	39.530	6,247,835.09
NMC HEALTH PLC	3,940	0.010	39.40
SMITH & NEPHEW PLC	57,278	11.045	632,635.51
ASTRAZENECA PLC	95,562	105.000	10,034,010.00
GSK PLC	249,255	13.486	3,361,452.93
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	14,590	12.855	187,554.45
BARCLAYS PLC	1,083,154	1.688	1,828,363.95
HSBC HOLDINGS PLC	1,255,233	5.250	6,589,973.25
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,324,726	0.459	1,985,049.23
NATWEST GROUP PLC	347,420	2.608	906,071.36
STANDARD CHARTERED PLC	172,614	6.142	1,060,195.18
3I GROUP PLC	60,807	11.665	709,313.65
ABRDN PLC	186,537	1.513	282,230.48
HARGREAVES LANSDOWN PLC	31,008	8.568	265,676.54
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	21,345	80.040	1,708,453.80
M&G PLC	198,216	2.041	404,558.85
SCHRODERS PLC	10,491	26.600	279,060.60
ST JAMES'S PLACE PLC	33,823	11.430	386,596.89
ADMIRAL GROUP PLC	11,535	22.010	253,885.35
AVIVA PLC	174,060	4.431	771,259.86
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	386,391	2.623	1,013,503.59
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	59,286	6.148	364,490.32
PRUDENTIAL PLC	178,081	9.614	1,712,070.73
AVEVA GROUP PLC	6,037	29.440	177,729.28
SAGE GROUP PLC/THE	55,987	7.474	418,446.83
HALMA PLC	24,375	21.570	525,768.75
BT GROUP PLC	403,957	1.401	565,943.75
VODAFONE GROUP PLC	1,639,544	1.084	1,777,265.69
NATIONAL GRID PLC	224,329	10.710	2,402,563.59
SEVERN TRENT PLC	14,904	27.630	411,797.52
SSE PLC	70,532	17.900	1,262,522.80
UNITED UTILITIES GROUP PLC	42,035	10.560	443,889.60
AUTO TRADER GROUP PLC	51,319	6.584	337,884.29
INFORMA PLC	102,755	5.608	576,250.04
PEARSON PLC	39,623	9.158	362,867.43
WPP PLC	78,503	7.712	605,415.13

イギリス・ポンド小計		17,874,442		111,898,130.25 (18,560,542,865)	
イスラエル・シュケル	ICL GROUP LTD	41,773	31.750	1,326,292.75	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,389	679.900	944,381.10	
	BANK HAPOALIM BM	84,682	33.530	2,839,387.46	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	92,639	35.130	3,254,408.07	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	85,339	20.280	1,730,674.92	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	9,249	137.400	1,270,812.60	
	AZRIELI GROUP LTD	2,140	278.800	596,632.00	
	NICE LTD	3,919	724.000	2,837,356.00	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	7,438	156.200	1,161,815.60	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	88,555	6.020	533,101.10	
イスラエル・シュケル小計		417,123		16,494,861.60 (690,959,856)	
スイス・フラン	CLARIANT AG-REG	10,101	18.140	183,232.14	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	356	678.000	241,368.00	
	GIVAUDAN-REG	568	3,099.000	1,760,232.00	
	HOLCIM LTD	35,246	45.430	1,601,225.78	
	SIG GROUP AG	22,269	23.180	516,195.42	
	SIKA AG-REG	9,291	224.800	2,088,616.80	
	ABB LTD-REG	103,720	27.380	2,839,853.60	
	GEBERIT AG-REG	2,322	453.700	1,053,491.40	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,766	164.000	289,624.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,132	169.550	361,480.60	
	VAT GROUP AG	1,436	241.200	346,363.20	
	ADECCO GROUP AG-REG	9,118	31.030	282,931.54	
	SGS SA-REG	374	2,241.000	838,134.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	3,570	219.000	781,830.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	32,770	107.050	3,508,028.50	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,716	225.900	387,644.40	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	2,516	42.280	106,376.48	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	216	1,977.000	427,032.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	59	10,380.000	612,420.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	6	105,600.000	633,600.00	
	NESTLE SA-REG	175,046	111.620	19,538,634.52	
	ALCON INC	31,165	66.160	2,061,876.40	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,269	248.800	813,327.20	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	7,044	110.950	781,531.80	
	BACHEM HOLDING AG	1,756	60.850	106,852.60	
	LONZA GROUP AG-REG	4,715	530.200	2,499,893.00	
NOVARTIS AG-REG	135,349	79.360	10,741,296.64		
ROCHE HOLDING AG-BR	1,740	388.800	676,512.00		
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	43,193	324.250	14,005,330.25		
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	168,196	5.180	871,255.28		

	JULIUS BAER GROUP LTD	15,168	48.690	738,529.92	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,372	956.600	1,312,455.20	
	UBS GROUP AG-REG	221,255	15.830	3,502,466.65	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,475	139.100	344,272.50	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,834	513.800	942,309.20	
	SWISS RE AG	19,228	81.380	1,564,774.64	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	9,220	424.600	3,914,812.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,906	82.950	324,002.70	
	TEMENOS AG - REG	3,743	80.500	301,311.50	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	10,426	48.490	505,556.74	
	SWISSCOM AG-REG	1,709	494.400	844,929.60	
	スイス・フラン小計	1,101,361		85,251,610.20 (12,689,702,178)	
デンマーク・クローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	7,211	424.900	3,063,953.90	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	11,512	420.200	4,837,342.40	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	513	1,433.500	735,385.50	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	65,433	182.120	11,916,657.96	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	206	15,680.000	3,230,080.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	311	16,230.000	5,047,530.00	
	DSV A/S	11,417	1,075.000	12,273,275.00	
	PANDORA A/S	5,888	433.900	2,554,803.20	
	CARLSBERG AS-B	5,585	947.800	5,293,463.00	
	COLOPLAST-B	6,399	907.800	5,809,012.20	
	DEMANT A/S	8,178	235.700	1,927,554.60	
	GN STORE NORD A/S	6,484	220.500	1,429,722.00	
	GENMAB A/S	3,934	2,779.000	10,932,586.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	103,208	799.800	82,545,758.40	
	DANSKE BANK A/S	39,103	102.050	3,990,461.15	
TRYG A/S	24,975	170.150	4,249,496.25		
ORSTED A/S	12,090	727.400	8,794,266.00		
	デンマーク・クローネ小計	312,447		168,631,347.56 (3,261,330,262)	
ノルウェー・クローネ	AKER BP ASA	21,204	342.800	7,268,731.20	
	EQUINOR ASA	60,849	356.200	21,674,413.80	
	NORSK HYDRO ASA	87,753	67.420	5,916,307.26	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,005	416.200	3,747,881.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	4,176	327.400	1,367,222.40	
	MOWI ASA	23,318	196.850	4,590,148.30	
	ORKLA ASA	46,955	82.060	3,853,127.30	
	SALMAR ASA	4,188	629.500	2,636,346.00	
	DNB BANK ASA	61,691	180.250	11,119,802.75	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,412	203.600	2,323,483.20	
	TELENOR ASA	40,694	105.900	4,309,494.60	
	ADEVINTA ASA	15,540	82.700	1,285,158.00	
	ノルウェー・クローネ小計	386,785		70,092,115.81	

				(1,012,831,073)	
スウェーデン・クロナ	BOLIDEN AB	15,297	352.700	5,395,251.90	
	HOLMEN AB-B SHARES	7,024	442.000	3,104,608.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	34,370	152.100	5,227,677.00	
	ALFA LAVAL AB	18,697	291.900	5,457,654.30	
	ASSA ABLOY AB-B	62,454	220.100	13,746,125.40	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	169,730	111.800	18,975,814.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	89,280	99.970	8,925,321.60	
	EPIROC AB-A	44,746	167.050	7,474,819.30	
	EPIROC AB-B	19,836	149.650	2,968,457.40	
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	71.040	1,320,846.72	
	INDUTRADE AB	17,913	204.600	3,664,999.80	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,223	208.000	1,710,384.00	
	LIFCO AB-B SHS	15,149	175.700	2,661,679.30	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	89,271	110.600	9,873,372.60	
	SANDVIK AB	70,108	165.500	11,602,874.00	
	SKANSKA AB-B SHS	26,915	157.850	4,248,532.75	
	SKF AB-B SHARES	20,607	158.250	3,261,057.75	
	VOLVO AB-A SHS	13,283	176.200	2,340,464.60	
	VOLVO AB-B SHS	90,883	169.160	15,373,768.28	
	SECURITAS AB-B SHS	16,123	88.380	1,424,950.74	
	VOLVO CAR AB-B	38,628	58.920	2,275,961.76	
	ELECTROLUX AB-B	11,555	129.500	1,496,372.50	
	EVOLUTION AB	11,254	890.500	10,021,687.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	40,148	112.120	4,501,393.76	
	SWEDISH MATCH AB	103,037	108.500	11,179,514.50	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	36,076	231.500	8,351,594.00	
	GETINGE AB-B SHS	13,151	205.600	2,703,845.60	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	13,513	224.900	3,039,073.70	
	NORDEA BANK ABP	210,076	102.080	21,444,558.08	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	108,374	106.900	11,585,180.60	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	97,603	87.820	8,571,495.46	
	SWEDBANK AB - A SHARES	57,603	143.850	8,286,191.55	
	EQT AB	15,443	257.600	3,978,116.80	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	7,211	236.300	1,703,959.30		
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,642	234.200	2,492,356.40		
INVESTOR AB-A SHS	27,415	181.550	4,977,193.25		
INVESTOR AB-B SHS	111,744	173.320	19,367,470.08		
KINNEVIK AB - B	12,465	153.850	1,917,740.25		
LUNDBERGS AB-B SHS	6,081	437.400	2,659,829.40		
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	31,938	59.110	1,887,855.18		
SAGAX AB-B	14,721	229.500	3,378,469.50		
ERICSSON LM-B SHS	183,318	79.450	14,564,615.10		
HEXAGON AB-B SHS	117,010	114.000	13,339,140.00		

	TELE2 AB-B SHS	38,424	106.800	4,103,683.20	
	TELIA CO AB	187,675	35.730	6,705,627.75	
	EMBRACER GROUP AB	30,012	67.500	2,025,810.00	
	スウェーデン・クローナ小計	2,383,619		305,317,394.16 (4,118,731,647)	
ユーロ	ENI SPA	154,027	11.682	1,799,343.41	
	GALP ENERGIA SGPS SA	25,920	10.370	268,790.40	
	NESTE OYJ	26,563	47.790	1,269,445.77	
	OMV AG	8,389	41.400	347,304.60	
	REPSOL SA	96,457	13.110	1,264,551.27	
	TENARIS SA	25,963	14.030	364,260.89	
	TOTALENERGIES SE	151,954	49.835	7,572,627.59	
	AIR LIQUIDE SA	32,024	122.840	3,933,828.16	
	AKZO NOBEL N.V.	12,475	63.700	794,657.50	
	ARCELORMITTAL	37,054	22.935	849,833.49	
	ARKEMA	3,250	85.940	279,305.00	
	BASF SE	56,522	43.485	2,457,859.17	
	COVESTRO AG	11,797	31.730	374,318.81	
	CRH PLC	45,964	36.630	1,683,661.32	
	EVONIK INDUSTRIES AG	17,669	19.470	344,015.43	
	HEIDELBERGCEMENT AG	8,677	46.800	406,083.60	
	KONINKLIJKE DSM NV	10,433	126.850	1,323,426.05	
	OCI NV	6,000	38.040	228,240.00	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	17,189	33.600	577,550.40	
	SOLVAY SA	4,802	82.580	396,549.16	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	30,234	14.140	427,508.76	
	SYMRISE AG	8,404	105.050	882,840.20	
	UMICORE	13,160	31.870	419,409.20	
	UPM-KYMMENE OYJ	32,818	34.120	1,119,750.16	
	VOESTALPINE AG	7,382	20.540	151,626.28	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	13,189	23.010	303,478.89	
	AIRBUS SE	36,169	96.000	3,472,224.00	
	ALSTOM	17,665	21.210	374,674.65	
	BOUYGUES SA	17,123	29.740	509,238.02	
	BRENTAG SE	9,920	67.880	673,369.60	
	CNH INDUSTRIAL NV	68,766	12.360	849,947.76	
	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	29,471	41.490	1,222,751.79	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	29,358	25.150	738,353.70	
	DASSAULT AVIATION SA	1,720	132.500	227,900.00	
	EIFFAGE	4,989	89.180	444,919.02	
	FERROVIAL SA	31,613	25.160	795,383.08	
	GEA GROUP AG	8,178	34.180	279,524.04	
	IMCD NV	3,214	135.850	436,621.90	
	KINGSPAN GROUP PLC	9,597	60.240	578,123.28	
	KION GROUP AG	3,179	34.150	108,562.85	

KNORR-BREMSE AG	3,881	48.070	186,559.67
KONE OYJ-B	20,623	40.120	827,394.76
LEGRAND SA	16,852	74.960	1,263,225.92
MTU AERO ENGINES AG	2,957	170.650	504,612.05
PRYSMIAN SPA	17,186	32.590	560,091.74
RATIONAL AG	350	494.400	173,040.00
RHEINMETALL AG	2,899	154.350	447,460.65
SAFRAN SA	21,782	103.800	2,260,971.60
SCHNEIDER ELECTRIC SE	33,134	126.060	4,176,872.04
SIEMENS AG-REG	46,887	105.000	4,923,135.00
SIEMENS ENERGY AG	31,878	14.000	446,292.00
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	19,773	17.950	354,925.35
THALES SA	7,074	116.500	824,121.00
VINCI SA	34,050	94.300	3,210,915.00
WARTSILA OYJ ABP	26,753	8.134	217,608.90
BUREAU VERITAS SA	17,817	25.030	445,959.51
RANDSTAD NV	6,241	47.950	299,255.95
TELEPERFORMANCE	3,420	296.200	1,013,004.00
WOLTERS KLUWER	16,360	101.850	1,666,266.00
ADP	1,346	133.900	180,229.40
AENA SME SA	4,377	120.150	525,896.55
ATLANTIA SPA	26,501	22.840	605,282.84
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	33,148	6.288	208,434.62
DEUTSCHE POST AG-REG	62,178	36.310	2,257,683.18
GETLINK SE	30,428	17.715	539,032.02
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	20,347	73.510	1,495,707.97
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	3,679	70.150	258,081.85
CONTINENTAL AG	8,078	57.360	463,354.08
FERRARI NV	7,986	195.550	1,561,662.30
MERCEDES-BENZ GROUP AG	49,688	56.370	2,800,912.56
MICHELIN (CGDE)	45,659	24.310	1,109,970.29
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	10,089	66.840	674,348.76
RENAULT SA	14,764	29.375	433,692.50
STELLANTIS NV	139,238	13.292	1,850,751.49
VALEO	14,444	19.095	275,808.18
VOLKSWAGEN AG	1,960	184.900	362,404.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	11,844	146.980	1,740,831.12
ADIDAS AG	10,395	145.360	1,511,017.20
ESSILORLUXOTTICA	17,807	153.100	2,726,251.70
HERMES INTERNATIONAL	1,973	1,309.000	2,582,657.00
KERING	4,486	522.200	2,342,589.20
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	17,101	652.300	11,154,982.30
MONCLER SPA	12,209	45.010	549,527.09
PUMA SE	6,459	60.380	389,994.42

SEB SA	1,127	70.150	79,059.05
ACCOR SA	10,451	23.970	250,510.47
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	10,188	118.150	1,203,712.20
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,785	32.900	190,326.50
SODEXO SA	4,760	81.280	386,892.80
DELIVERY HERO SE	8,530	49.080	418,652.40
D' IETEREN GROUP	1,449	155.700	225,609.30
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	71,341	21.470	1,531,691.27
JUST EAT TAKEAWAY	9,307	17.492	162,798.04
PROSUS NV	51,027	59.850	3,053,965.95
ZALANDO SE	12,367	22.970	284,069.99
CARREFOUR SA	35,990	16.515	594,374.85
HELLOFRESH SE	9,790	26.440	258,847.60
JERONIMO MARTINS	20,863	22.260	464,410.38
KESKO OYJ-B SHS	20,250	21.240	430,110.00
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	64,661	27.900	1,804,041.90
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	52,478	49.470	2,596,086.66
DANONE	40,711	51.080	2,079,517.88
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	35,407	9.554	338,278.47
HEINEKEN HOLDING NV	6,168	71.450	440,703.60
HEINEKEN NV	16,091	91.480	1,472,004.68
JDE PEET'S NV	6,660	30.540	203,396.40
KERRY GROUP PLC-A	9,894	100.400	993,357.60
PERNOD RICARD SA	12,775	188.750	2,411,281.25
REMY COINTREAU	1,273	181.700	231,304.10
BEIERSDORF AG	6,813	102.300	696,969.90
HENKEL AG & CO KGAA	5,974	60.750	362,920.50
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	10,398	62.380	648,627.24
L'OREAL	15,195	345.300	5,246,833.50
AMPLIFON SPA	7,567	25.920	196,136.64
BIOMERIEUX	2,791	92.060	256,939.46
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,161	126.200	272,718.20
DIASORIN SPA	1,313	134.600	176,729.80
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	13,613	33.390	454,538.07
FRESENIUS SE & CO KGAA	23,254	25.440	591,581.76
KONINKLIJKE PHILIPS NV	52,727	17.950	946,449.65
SIEMENS HEALTHINEERS AG	16,426	49.860	819,000.36
ARGENX SE	3,503	393.400	1,378,080.20
BAYER AG-REG	60,149	52.870	3,180,077.63
EUROFINS SCIENTIFIC	9,270	69.000	639,630.00
GRIFOLS SA	15,169	12.470	189,157.43
IPSEN	1,498	100.600	150,698.80
MERCK KGAA	7,777	174.400	1,356,308.80
ORION OYJ-CLASS B	6,261	44.950	281,431.95

QIAGEN N.V.	15,665	46.420	727,169.30
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	8,068	40.630	327,802.84
SANOFI	70,543	81.200	5,728,091.60
SARTORIUS AG-VORZUG	1,682	433.300	728,810.60
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,555	385.000	598,675.00
UCB SA	7,782	71.100	553,300.20
ABN AMRO BANK NV-CVA	28,787	10.095	290,604.76
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	420,232	4.852	2,038,965.66
BANCO SANTANDER SA	1,046,474	2.535	2,652,811.59
BNP PARIBAS	68,484	48.680	3,333,801.12
CAIXABANK SA	245,314	3.328	816,404.99
COMMERZBANK AG	60,640	7.538	457,104.32
CREDIT AGRICOLE SA	73,102	9.425	688,986.35
ERSTE GROUP BANK AG	23,071	24.550	566,393.05
FINECOBANK SPA	43,093	11.725	505,265.42
ING GROEP NV	229,641	9.043	2,076,643.56
INTESA SANPAOLO	1,011,886	1.833	1,854,787.03
KBC GROUP NV	14,910	51.400	766,374.00
MEDIOBANCA SPA	47,708	8.282	395,117.65
SOCIETE GENERALE SA	48,558	23.735	1,152,524.13
UNICREDIT SPA	127,961	10.372	1,327,211.49
AMUNDI SA	3,955	51.850	205,066.75
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	127,233	8.932	1,136,445.15
DEUTSCHE BOERSE AG	11,916	170.150	2,027,507.40
EURAZEO SE	1,792	58.900	105,548.80
EURONEXT NV	5,502	70.380	387,230.76
EXOR NV	6,204	64.440	399,785.76
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,914	76.760	453,958.64
SOFINA	804	202.200	162,568.80
WENDEL	1,082	78.750	85,207.50
AEGON NV	127,748	4.580	585,085.84
AGEAS	11,247	40.670	457,415.49
ALLIANZ SE-REG	24,953	168.620	4,207,574.86
ASSICURAZIONI GENERALI	64,729	14.950	967,698.55
AXA SA	119,547	24.885	2,974,927.09
HANNOVER RUECK SE	3,598	158.100	568,843.80
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	9,023	255.800	2,308,083.40
NN GROUP NV	16,917	40.820	690,551.94
POSTE ITALIANE SPA	34,720	8.210	285,051.20
SAMPO OYJ-A SHS	29,843	45.910	1,370,092.13
AROUNDTOWN SA	73,508	2.843	208,983.24
LEG IMMOBILIEN SE	4,538	73.860	335,176.68
VONOVIA SE	46,339	26.110	1,209,911.29
ADYEN NV	1,394	1,487.600	2,073,714.40

AMADEUS IT GROUP SA	26,736	52.160	1,394,549.76	
BECHTLE AG	4,305	41.870	180,250.35	
CAPGEMINI SE	10,453	179.400	1,875,268.20	
DASSAULT SYSTEMES SE	40,049	39.275	1,572,924.47	
EDENRED	14,650	51.060	748,029.00	
NEMETSCHEK SE	3,011	58.960	177,528.56	
NEXI SPA	30,853	8.496	262,127.08	
SAP SE	64,997	86.590	5,628,090.23	
WORLDLINE SA	16,677	46.860	781,484.22	
NOKIA OYJ	348,610	5.070	1,767,452.70	
ASM INTERNATIONAL NV	3,170	287.650	911,850.50	
ASML HOLDING NV	25,040	497.900	12,467,416.00	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	79,641	25.430	2,025,270.63	
STMICROELECTRONICS NV	43,538	36.940	1,608,293.72	
CELLNEX TELECOM SA	32,830	38.150	1,252,464.50	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	200,747	19.550	3,924,603.85	
ELISA OYJ	8,681	51.120	443,772.72	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,804	9.432	149,063.32	
KONINKLIJKE KPN NV	222,179	3.124	694,087.19	
ORANGE	127,798	10.102	1,291,015.39	
PROXIMUS	10,895	12.170	132,592.15	
TELECOM ITALIA SPA	696,355	0.197	137,181.93	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	79,654	2.454	195,470.91	
TELEFONICA SA	335,910	3.929	1,319,790.39	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,269	21.890	115,338.41	
ACCIONA SA	1,810	199.700	361,457.00	
E.ON SE	147,318	9.088	1,338,825.98	
EDF	32,658	11.990	391,569.42	
EDP RENOVAVEIS SA	17,764	25.120	446,231.68	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	170,355	4.935	840,701.92	
ELIA GROUP SA/NV	2,111	142.300	300,395.30	
ENAGAS SA	14,471	17.770	257,149.67	
ENDESA SA	14,104	17.475	246,467.40	
ENEL SPA	501,060	4.855	2,432,646.30	
ENGIE	117,899	12.776	1,506,277.62	
FORTUM OYJ	24,312	9.846	239,375.95	
IBERDROLA SA	365,401	10.710	3,913,444.71	
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,603	27.520	291,794.56	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	23,632	18.075	427,148.40	
RWE AG	38,604	41.500	1,602,066.00	
SNAM SPA	133,867	4.765	637,876.25	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA	75,662	7.104	537,502.84	
UNIPER SE	4,697	5.155	24,213.03	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	42,162	22.690	956,655.78	

VERBUND AG	4,072	92.550	376,863.60
BOLLORE SE	69,288	4.794	332,166.67
PUBLICIS GROUPE	13,301	51.560	685,799.56
SCOUT24 SE	4,671	59.960	280,073.16
UBISOFT ENTERTAINMENT	4,745	36.510	173,239.95
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	44,422	19.570	869,338.54
VIVENDI SE	38,496	8.686	334,376.25
ユーロ小計	11,489,580		254,557,354.04 (36,612,984,232)
合計	68,385,443		418,939,787,808 (418,939,787,808)

(注) 金額欄の()内は、外貨建保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 602銘柄	71.2%	74.5%
カナダ・ドル	株式 85銘柄	3.7%	3.8%
オーストラリア・ドル	株式 49銘柄	2.0%	2.1%
香港・ドル	株式 28銘柄	0.7%	0.8%
シンガポール・ドル	株式 14銘柄	0.3%	0.3%
ニュージーランド・ドル	株式 5銘柄	0.1%	0.1%
イギリス・ポンド	株式 80銘柄	4.2%	4.4%
イスラエル・シケル	株式 10銘柄	0.2%	0.2%
スイス・フラン	株式 41銘柄	2.9%	3.0%
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	0.7%	0.8%
ノルウェー・クローネ	株式 12銘柄	0.2%	0.2%
スウェーデン・クローナ	株式 46銘柄	0.9%	1.0%
ユーロ	株式 223銘柄	8.3%	8.7%

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9,773.00	1,552,343.32	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	20,093.00	744,445.65	
		AMERICAN TOWER CORP	27,941.00	7,309,086.19	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	90,010.00	598,566.50	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	9,096.00	1,950,728.16	
		BOSTON PROPERTIES INC	9,604.00	824,023.20	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,009.00	810,253.56	
		CROWN CASTLE INC	27,033.00	4,718,610.15	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	18,137.00	2,257,149.65	
		DUKE REALTY CORP	24,944.00	1,527,321.12	
		EQUINIX INC	5,560.00	3,657,868.40	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	11,186.00	812,551.04	
		EQUITY RESIDENTIAL	22,609.00	1,745,866.98	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,379.00	1,218,500.54			

	EXTRA SPACE STORAGE INC	8,530.00	1,721,780.50	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	17,613.00	880,297.74	
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	22,843.00	562,166.23	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	36,377.00	995,274.72	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	46,189.00	842,487.36	
	INVITATION HOMES INC	36,871.00	1,458,248.05	
	IRON MOUNTAIN INC	19,659.00	1,085,766.57	
	KIMCO REALTY CORP	35,169.00	774,069.69	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	31,858.00	473,091.30	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	6,678.00	1,153,290.60	
	PROLOGIS INC	46,056.00	5,970,239.28	
	PUBLIC STORAGE	9,559.00	3,242,030.44	
	REALTY INCOME CORP	36,686.00	2,450,257.94	
	REGENCY CENTERS CORP	9,608.00	598,386.24	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	6,447.00	2,132,474.19	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	20,565.00	2,134,030.05	
	SUN COMMUNITIES INC	7,129.00	1,131,586.17	
	UDR INC	20,610.00	988,867.80	
	VENTAS INC	23,363.00	1,158,804.80	
	VICI PROPERTIES INC	60,354.00	2,035,136.88	
	VORNADO REALTY TRUST	8,706.00	241,156.20	
	WELLTOWER INC	27,308.00	2,118,827.72	
	WEYERHAEUSER CO	47,220.00	1,634,756.40	
	WP CAREY INC	11,067.00	954,086.07	
	アメリカ・ドル小計	882,839.00	66,464,427.40 (9,492,449,521)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,971.00	182,705.71	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,441.00	152,242.86	
	カナダ・ドル小計	11,412.00	334,948.57 (36,750,557)	
オーストラリア・ドル	APA GROUP	75,718.00	808,668.24	
	DEXUS/AU	59,026.00	499,359.96	
	GOODMAN GROUP	106,251.00	2,024,081.55	
	GPT GROUP	121,221.00	511,552.62	
	LENDLEASE GROUP	36,263.00	368,794.71	
	MIRVAC GROUP	251,619.00	533,432.28	
	SCENTRE GROUP	350,311.00	1,008,895.68	
	STOCKLAND	127,393.00	456,066.94	
	TRANSURBAN GROUP	190,071.00	2,630,582.64	
	VICINITY CENTRES	241,241.00	476,450.97	
	オーストラリア・ドル小計	1,559,114.00	9,317,885.59 (910,823,316)	
香港・ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	193,500.00	1,186,155.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	276,000.00	2,886,960.00	

	LINK REIT	136,600.00	8,510,180.00	
	香港・ドル小計	606,100.00	12,583,295.00 (228,890,136)	
シンガ ポール・ ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	219,000.00	632,910.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	303,516.00	637,383.60	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	208,100.00	366,256.00	
	MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	112,400.00	215,808.00	
	シンガポール・ドル小計	843,016.00	1,852,357.60 (189,125,711)	
イギリ ス・ボン ド	BRITISH LAND CO PLC	49,008.00	202,942.12	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	39,861.00	253,117.35	
	SEGRO PLC	78,831.00	733,601.28	
	イギリス・ポンド小計	167,700.00	1,189,660.75 (197,329,029)	
ユーロ	COVIVIO	2,388.00	130,743.00	
	GECINA SA	3,082.00	283,852.20	
	KLEPIERRE	13,600.00	277,712.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	7,024.00	364,686.08	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	9,913.00	293,226.54	
	ユーロ小計	36,007.00	1,350,219.82 (194,202,117)	
投資証券合計			11,249,570,387 (11,249,570,387)	
合 計			11,249,570,387 (11,249,570,387)	

(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	38銘柄	2.2%	84.4%
カナダ・ドル	投資証券	2銘柄	0.0%	0.3%
オーストラリア・ドル	投資証券	10銘柄	0.2%	8.1%
香港・ドル	投資証券	3銘柄	0.1%	2.0%
シンガポール・ドル	投資証券	4銘柄	0.0%	1.7%
イギリス・ポンド	投資証券	3銘柄	0.0%	1.8%
ユーロ	投資証券	5銘柄	0.0%	1.7%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

(2021年9月10日現在)

(2022年9月12日現在)

資産の部

流動資産		
預金	470,155,265	1,576,229,216
金銭信託	687,797,401	2,158,311
コール・ローン	1,332,614,183	60,662,910
株式	10,258,945,460	19,267,678,516
投資信託受益証券	597,223,100	1,211,446,537
投資証券	1,156,670,380	1,910,817,739
派生商品評価勘定	9,218,227	1,804,422
未収入金	11,344,215	-
未収配当金	16,572,170	47,894,311
前払金	109,080,702	-
差入委託証拠金	783,816,283	394,092,069
流動資産合計	15,433,437,386	24,472,784,031
資産合計	15,433,437,386	24,472,784,031
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	118,872,862	42,882,179
未払金	11,288,030	-
未払解約金	2,000,000	4,239,510
未払利息	2,939	-
その他未払費用	52,052	597
流動負債合計	132,215,883	47,122,286
負債合計	132,215,883	47,122,286
純資産の部		
元本等		
元本	8,888,051,553	14,201,860,735
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	6,413,169,950	10,223,801,010
元本等合計	15,301,221,503	24,425,661,745
純資産合計	15,301,221,503	24,425,661,745
負債純資産合計	15,433,437,386	24,472,784,031

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2021年9月11日 至 2022年9月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、新株予約権証券、投資信託受益証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p>

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年9月10日現在)	(2022年9月12日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	8,888,051,553口	14,201,860,735口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.7215円 (1万口当たりの純資産額17,215円)	1口当たり純資産額 1.7199円 (1万口当たりの純資産額17,199円)

(金融商品に関する注記)

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年9月11日 至 2022年9月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券、投資信託受益証券、投資証券を組み入れております。 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>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</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>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2022年9月12日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（株式、投資信託受益証券、投資証券）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年9月10日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MSCIE 2109	3,384,270,395	-	3,275,189,694	109,080,701
	小計	3,384,270,395	-	3,275,189,694	109,080,701
合計		3,384,270,395	-	3,275,189,694	109,080,701

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	2,018,400,000	-	2,017,826,067	573,933
	小計	2,018,400,000	-	2,017,826,067	573,933
合計		2,018,400,000	-	2,017,826,067	573,933

(2022年9月12日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MSCI EMGMKT SEP22	2,116,071,821	-	2,075,161,032	40,910,789
	小計	2,116,071,821	-	2,075,161,032	40,910,789
合計		2,116,071,821	-	2,075,161,032	40,910,789

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		

市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	63,000,000	-	62,833,032	166,968
	小計	63,000,000	-	62,833,032	166,968
合 計		63,000,000	-	62,833,032	166,968

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2021年9月11日 至 2022年9月12日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2021年9月10日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	7,337,581,576円
同期中における追加設定元本額	4,294,504,179円
同期中における一部解約元本額	2,744,034,202円
2021年9月10日現在の元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	5,047,718,540円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	2,439,575,264円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	113,631,478円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	259,905,633円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	172,813,862円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	24,208,151円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	70,544,068円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	52,317,201円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	205,349,178円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	151,161,592円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	251,538,782円

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	58,243,277円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	3,294,170円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	586,270円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	592,453円
三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド	611,846円
SMAAM・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>	35,959,788円
合 計	8,888,051,553円

(2022年9月12日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	8,888,051,553円
同期中における追加設定元本額	7,116,611,786円
同期中における一部解約元本額	1,802,802,604円
2022年9月12日現在の元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	7,759,749,632円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	2,877,312,344円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	49,002,422円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	236,594,721円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	155,000,946円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	34,122,519円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	94,365,741円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	70,242,472円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	299,371,907円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	243,657,870円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	400,901,356円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	94,046,132円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	4,741,880円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	494,788,425円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	1,312,279,169円
三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド	11,175,759円
SMAAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	64,507,440円
合 計	14,201,860,735円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	26,200	1.703	44,618.60	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	4,068	6.330	25,750.44	
	SOUTHERN COPPER CORP	2,096	49.200	103,123.20	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	10,416	26.790	279,044.64	
	LI AUTO INC - ADR	13,478	26.330	354,875.74	
	NIO INC - ADR	33,895	19.160	649,428.20	
	XPENG INC - ADR	10,439	16.030	167,337.17	

	H WORLD GROUP LTD-ADR	4,760	36.030	171,502.80	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	11,121	5.400	60,053.40	
	TRIP.COM GROUP LTD-ADR	13,447	25.550	343,570.85	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	10,389	49.600	515,294.40	
	PINDUODUO INC-ADR	12,466	69.760	869,628.16	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	10,692	10.720	114,618.24	
	RLX TECHNOLOGY INC-ADR	10,343	1.370	14,169.91	
	BEIGENE LTD-ADR	1,163	170.710	198,535.73	
	HUTCHMED CHINA-ADR	1,444	13.970	20,172.68	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	1,201	44.510	53,456.51	
	ZAI LAB LTD-ADR	2,172	48.800	105,993.60	
	CREDICORP LTD	1,764	130.850	230,819.40	
	360 DIGITECH INC	2,669	14.570	38,887.33	
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	18,837	3.960	74,594.52	
	KE HOLDINGS INC-ADR	16,424	18.030	296,124.72	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	27,780	0.843	23,418.54	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	12,430	3.255	40,459.65	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	1,469	64.950	95,411.55	
	AUTOHOME INC-ADR	2,090	34.870	72,878.30	
	IQIYI INC-ADR	7,166	3.360	24,077.76	
	JOYY INC-ADR	1,164	29.250	34,047.00	
	KANZHUN LTD - ADR	4,491	22.760	102,215.16	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	19,174	4.770	91,459.98	
	WEIBO CORP-SPON ADR	1,472	18.600	27,379.20	
	アメリカ・ドル小計	296,720		5,242,947.38 (748,797,745)	
香港・ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	51,000	7.570	386,070.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	38,000	8.440	320,720.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	646,000	3.530	2,280,380.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	83,500	25.700	2,145,950.00	
	CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	29,000	3.700	107,300.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	520,000	3.500	1,820,000.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	38,000	33.900	1,288,200.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	72,000	3.250	234,000.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	32,500	29.750	966,875.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	47,000	7.800	366,600.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	104,000	7.560	786,240.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	52,000	4.620	240,240.00	
	CMOC GROUP LTD-H	66,000	3.590	236,940.00	
	DONGYUE GROUP	43,000	8.950	384,850.00	
	GANFENG LITHIUM CO LTD-H	8,400	65.900	553,560.00	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	20,000	10.040	200,800.00	
	MMG LTD	80,000	2.200	176,000.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	37,000	6.330	234,210.00	

SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	14,250	13.580	193,515.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	33,000	5.940	196,020.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	142,000	9.270	1,316,340.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	51,000	3.660	186,660.00	
BOC AVIATION LTD	6,100	60.700	370,270.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	54,000	3.270	176,580.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	44,500	15.560	692,420.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	23,000	8.930	205,390.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	104,000	4.480	465,920.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	42,000	9.300	390,600.00	
CITIC LTD	143,000	8.200	1,172,600.00	
CRRC CORP LTD - H	85,000	2.900	246,500.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	72,000	5.110	367,920.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	13,000	17.600	228,800.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	19,000	8.370	159,030.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	10,000	7.240	72,400.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	46,000	10.300	473,800.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	16,218	11.680	189,426.24	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	13,500	36.500	492,750.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	29,800	3.470	103,406.00	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	77,000	3.670	282,590.00	
AIR CHINA LTD-H	56,000	6.090	341,040.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	44,000	4.720	207,680.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	38,140	11.520	439,372.80	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	40,000	4.130	165,200.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	78,400	10.200	799,680.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	38,000	5.220	198,360.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	22,000	6.730	148,060.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	3,000	144.700	434,100.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	27,000	6.450	174,150.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	32,000	6.030	192,960.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	30,000	4.390	131,700.00	
BYD CO LTD-H	20,500	221.600	4,542,800.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	70,000	4.860	340,200.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	16,800	38.350	644,280.00	
GEEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	148,000	14.160	2,095,680.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	81,500	11.420	930,730.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	81,200	6.820	553,784.00	
MINTH GROUP LTD	22,000	22.500	495,000.00	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	34,000	14.560	495,040.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	30,800	92.500	2,849,000.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	72,000	4.040	290,880.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	56,600	25.950	1,468,770.00	
LI NING CO LTD	58,000	67.200	3,897,600.00	

SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	20,400	74.150	1,512,660.00	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	33,000	10.280	339,240.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	31,000	16.900	523,900.00	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	16,000	15.380	246,080.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	37,500	21.050	789,375.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	25,600	15.780	403,968.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	374,600	89.800	33,639,080.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	100,000	4.410	441,000.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	12,000	15.500	186,000.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	27,500	52.700	1,449,250.00	
JD.COM INC - CL A	53,435	243.400	13,006,079.00	
MEITUAN-CLASS B	108,900	179.900	19,591,110.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	13,500	21.750	293,625.00	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	11,800	18.720	220,896.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	49,000	6.400	313,600.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	16,500	36.000	594,000.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	2,700	119.000	321,300.00	
CHINA FEIHE LTD	98,000	5.960	584,080.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	80,000	33.000	2,640,000.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	42,000	53.150	2,232,300.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	51,000	3.460	176,460.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	44,800	44.400	1,989,120.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	44,000	13.000	572,000.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	48,000	13.880	666,240.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	16,000	70.050	1,120,800.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	28,000	6.370	178,360.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	129,000	5.280	681,120.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	9,000	17.460	157,140.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	15,000	36.000	540,000.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	9,000	19.540	175,860.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	8,400	46.800	393,120.00	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	49,500	4.810	238,095.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	15,700	16.400	257,480.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	67,200	10.520	706,944.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	16,600	11.540	191,564.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	33,200	16.500	547,800.00	
3SBIO INC	30,500	5.700	173,850.00	
CANSINO BIOLOGICS INC-H	2,600	54.000	140,400.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	27,000	10.980	296,460.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	86,000	3.260	280,360.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	228,800	7.980	1,825,824.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	30,000	23.250	697,500.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	2,500	76.500	191,250.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	34,000	13.600	462,400.00	

INNOVENT BIOLOGICS INC	23,000	29.000	667,000.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	5,100	49.400	251,940.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	10,500	21.600	226,800.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	271,000	4.010	1,086,710.00	
WUXI APPTTEC CO LTD-H	8,711	82.650	719,964.15	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	88,500	66.700	5,902,950.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	744,000	2.500	1,860,000.00	
BANK OF CHINA LTD-H	1,981,000	2.730	5,408,130.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	216,000	4.480	967,680.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	220,000	3.370	741,400.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	2,379,000	4.800	11,419,200.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	77,000	2.400	184,800.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	98,000	39.650	3,885,700.00	
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	131,100	2.460	322,506.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	1,406,000	3.920	5,511,520.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	196,000	4.790	938,840.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	188,000	1.030	193,640.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	86,500	4.220	365,030.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	32,000	14.360	459,520.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	48,000	15.760	756,480.00	
FAR EAST HORIZON LTD	28,000	5.870	164,360.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	27,200	10.900	296,480.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	60,800	5.070	308,256.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	32,400	10.400	336,960.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	189,000	11.340	2,143,260.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	65,000	16.680	1,084,200.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	35,400	7.990	282,846.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	21,700	17.360	376,712.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	174,000	2.430	422,820.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	170,000	8.800	1,496,000.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	157,500	47.500	7,481,250.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	14,900	23.500	350,150.00	
A-LIVING SMART CITY SERVICES	18,250	8.160	148,920.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	66,000	1.650	108,900.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	96,000	1.940	186,240.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	94,500	22.900	2,164,050.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	30,000	8.570	257,100.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	80,000	33.700	2,696,000.00	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	15,800	35.200	556,160.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	39,200	16.500	646,800.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	104,000	1.980	205,920.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	170,000	2.570	436,900.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	54,000	16.000	864,000.00	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	22,500	15.580	350,550.00	

GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	34,000	5.580	189,720.00	
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	12,100	10.200	123,420.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	47,500	28.250	1,341,875.00	
SEAZEN GROUP LTD	32,000	2.900	92,800.00	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	18,500	4.420	81,770.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	53,000	4.580	242,740.00	
WHARF HOLDINGS LTD	30,000	29.050	871,500.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	29,600	10.680	316,128.00	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	66,000	5.910	390,060.00	
GDS HOLDINGS LTD-CL A	23,900	22.550	538,945.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	68,000	13.400	911,200.00	
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	12,000	5.870	70,440.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	21,000	13.440	282,240.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	13,500	14.540	196,290.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	13,000	23.650	307,450.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	13,500	25.850	348,975.00	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	21,000	7.390	155,190.00	
LENOVO GROUP LTD	178,000	6.100	1,085,800.00	
SUNNY OPTICAL TECH	18,200	101.800	1,852,760.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	377,000	10.800	4,071,600.00	
ZTE CORP-H	16,600	16.760	278,216.00	
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	9,000	24.450	220,050.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	14,000	22.500	315,000.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	120,000	10.260	1,231,200.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	1,108,000	0.960	1,063,680.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	10,500	25.350	266,175.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	100,000	2.000	200,000.00	
CGN POWER CO LTD-H	229,000	1.890	432,810.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	79,600	11.240	894,704.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	87,000	13.300	1,157,100.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	148,000	4.450	658,600.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	24,900	29.100	724,590.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	52,000	16.780	872,560.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	20,000	113.900	2,278,000.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	62,000	7.130	442,060.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	114,000	4.670	532,380.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	106,000	6.610	700,660.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	260,000	0.600	156,000.00	
BAIDU INC-CLASS A	54,350	137.400	7,467,690.00	
BILIBILI INC-CLASS Z	4,880	152.100	742,248.00	
CHINA LITERATURE LTD	12,200	29.350	358,070.00	
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	96,000	1.920	184,320.00	
KINGSOFT CORP LTD	20,200	23.750	479,750.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	43,100	64.500	2,779,950.00	

	NETEASE INC	51,100	138.500	7,077,350.00	
	TENCENT HOLDINGS LTD	154,200	307.000	47,339,400.00	
	香港・ドル小計	20,338,934		292,093,739.19 (5,313,185,116)	
台湾・ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	24,000	81.400	1,953,600.00	
	ASIA CEMENT CORP	57,000	44.050	2,510,850.00	
	CHINA STEEL CORP	299,000	29.250	8,745,750.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	87,000	68.100	5,924,700.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	105,000	88.300	9,271,500.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	121,000	67.200	8,131,200.00	
	TAIWAN CEMENT	149,676	39.850	5,964,588.60	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	3,000	772.000	2,316,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	79,000	31.800	2,512,200.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	2,000	1,650.000	3,300,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	55,000	38.350	2,109,250.00	
	CHINA AIRLINES LTD	63,000	21.900	1,379,700.00	
	EVA AIRWAYS CORP	59,000	33.150	1,955,850.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	62,740	80.800	5,069,392.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	41,000	28.600	1,172,600.00	
	WAN HAI LINES LTD	14,605	74.100	1,082,230.50	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	43,000	67.800	2,915,400.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	44,000	34.900	1,535,600.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	4,000	469.500	1,878,000.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	10,640	171.500	1,824,760.00	
	GIANT MANUFACTURING	7,000	228.000	1,596,000.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	4,000	280.500	1,122,000.00	
	POU CHEN	54,000	29.100	1,571,400.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	7,000	597.000	4,179,000.00	
	MOMO.COM INC	1,200	685.000	822,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	13,000	283.000	3,679,000.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	119,000	66.900	7,961,100.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	99,741	17.500	1,745,467.50	
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	443,000	22.900	10,144,700.00	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	324,669	27.500	8,928,397.50	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	261,147	26.450	6,907,338.15	
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	218,970	23.000	5,036,310.00	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	281,700	35.000	9,859,500.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	252,737	17.950	4,536,629.15		
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	265,647	15.050	3,997,987.35		
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	242,108	27.250	6,597,443.00		
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	88,299	49.250	4,348,725.75		
CHAILEASE HOLDING CO LTD	33,836	193.500	6,547,266.00		
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	246,284	20.600	5,073,450.40		
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	200,000	43.150	8,630,000.00		

CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	381,196	13.050	4,974,607.80	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	179,000	56.500	10,113,500.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	323,432	8.570	2,771,812.24	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	24,180	60.300	1,458,054.00	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	12,000	270.500	3,246,000.00	
ACER INC	61,000	21.750	1,326,750.00	
ADVANTECH CO LTD	11,299	313.500	3,542,236.50	
ASUSTEK COMPUTER INC	17,000	249.000	4,233,000.00	
AUO CORP	202,000	17.350	3,504,700.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	18,000	169.000	3,042,000.00	
COMPAL ELECTRONICS	88,000	23.000	2,024,000.00	
DELTA ELECTRONICS INC	48,000	268.000	12,864,000.00	
E INK HOLDINGS INC	22,000	240.500	5,291,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	307,800	107.000	32,934,600.00	
INNOLUX CORP	268,000	12.050	3,229,400.00	
INVENTEC CORP	72,000	23.500	1,692,000.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	2,480	1,970.000	4,885,600.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	49,000	68.700	3,366,300.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	14,000	117.000	1,638,000.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	6,000	242.000	1,452,000.00	
PEGATRON CORP	53,000	63.700	3,376,100.00	
QUANTA COMPUTER INC	70,000	79.800	5,586,000.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	28,000	56.000	1,568,000.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	31,000	139.500	4,324,500.00	
WIWYNN CORP	2,000	765.000	1,530,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	33,520	52.300	1,753,096.00	
YAGEO CORPORATION	11,198	335.000	3,751,330.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	14,000	114.000	1,596,000.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	83,000	82.100	6,814,300.00	
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	500	835.000	417,500.00	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	2,000	1,375.000	2,750,000.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	5,000	458.000	2,290,000.00	
MEDIATEK INC	37,000	623.000	23,051,000.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	26,000	51.100	1,328,600.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	14,000	259.000	3,626,000.00	
PARADE TECHNOLOGIES LTD	2,000	758.000	1,516,000.00	
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	80,000	30.700	2,456,000.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	11,000	331.500	3,646,500.00	
SILERGY CORP	8,800	477.000	4,197,600.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	608,000	475.000	288,800,000.00	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	292,000	39.300	11,475,600.00	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	19,000	74.000	1,406,000.00	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	6,000	163.000	978,000.00	
WINBOND ELECTRONICS CORP	61,000	21.200	1,293,200.00	

	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	96,000	121.000	11,616,000.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	36,000	74.500	2,682,000.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	43,000	99.000	4,257,000.00	
	台湾・ドル小計	8,266,404		680,512,772.44 (3,140,974,751)	
エジプト・ポンド	EASTERN CO SAE	13,558	10.250	138,969.50	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BAN	37,184	39.220	1,458,356.48	
	EFG-HERMES HOLDING SAE	15,925	13.020	207,343.50	
	エジプト・ポンド小計	66,667		1,804,669.48 (13,335,244)	
トルコ・リラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	2,650	335.300	888,545.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	38,881	32.460	1,262,077.26	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	19,291	29.320	565,612.12	
	KOC HOLDING AS	15,538	51.100	793,991.80	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	39,792	26.200	1,042,550.40	
	TURK HAVA YOLLARI AO	13,066	73.400	959,044.40	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	1,688	351.000	592,488.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	12,175	121.200	1,475,610.00	
	AKBANK T.A.S.	70,766	15.920	1,126,594.72	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	27,103	28.560	774,061.68	
	TURKIYE IS BANKASI-C	86,259	12.440	1,073,061.96	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	27,080	24.020	650,461.60	
	トルコ・リラ小計	354,289		11,204,098.94 (87,839,014)	
メキシコ・ペソ	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	77,000	84.000	6,468,000.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	3,095	176.760	547,072.20	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	20,300	38.940	790,482.00	
	ALFA S.A.B.-A	83,900	13.150	1,103,285.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	11,100	69.730	774,003.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	8,900	290.800	2,588,120.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	4,780	439.900	2,102,722.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	5,105	140.090	715,159.45	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	131,500	74.020	9,733,630.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	10,900	140.580	1,532,322.00	
	GRUMA S.A.B.-B	5,050	221.990	1,121,049.50	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	32,900	73.030	2,402,687.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	31,900	28.340	904,046.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	65,300	124.990	8,161,847.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	53,100	33.190	1,762,389.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	697,100	17.250	12,024,975.00	
OPERADORA DE SITIS MEX- A-1	30,400	18.380	558,752.00		
	メキシコ・ペソ小計	1,272,330		53,290,541.15 (383,158,991)	
フィリピン・ペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	42,090	57.800	2,432,802.00	
	AYALA CORPORATION	6,750	717.000	4,839,750.00	

	GT CAPITAL HOLDINGS INC	1,310	502.000	657,620.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	82,562	50.100	4,136,356.20	
	SM INVESTMENTS CORP	5,405	865.000	4,675,325.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	23,130	184.300	4,262,859.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	12,830	246.000	3,156,180.00	
	MONDE NISSIN CORP	155,700	16.080	2,503,656.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	17,230	129.000	2,222,670.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	49,227	96.100	4,730,714.70	
	BDO UNIBANK INC	52,070	126.000	6,560,820.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	38,980	53.000	2,065,940.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	110,900	3.790	420,311.00	
	AYALA LAND INC	198,000	27.800	5,504,400.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	284,800	36.400	10,366,720.00	
	CONVERGE INFORMATION AND COM	47,400	17.100	810,540.00	
	GLOBE TELECOM INC	620	2,090.000	1,295,800.00	
	PLDT INC	2,005	1,654.000	3,316,270.00	
	ACEN CORP	141,680	7.040	997,427.20	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	5,120	318.000	1,628,160.00	
	フィリピン・ペソ小計	1,277,809		66,584,321.10 (167,326,399)	
チリ・ペソ	EMPRESAS COPEC SA	10,529	7,455.000	78,493,695.00	
	EMPRESAS CMPC SA	22,543	1,630.000	36,745,090.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	3,601	101,680.000	366,149,680.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	374,056	78.630	29,412,023.28	
	FALABELLA SA	15,911	2,200.000	35,004,200.00	
	CENCOSUD SA	40,071	1,350.000	54,095,850.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	1,586	5,006.100	7,939,674.60	
	BANCO DE CHILE	1,024,325	86.800	88,911,410.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	1,084	27,199.000	29,483,716.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	1,825,075	37.480	68,403,811.00	
	ENEL AMERICAS SA	600,505	100.900	60,590,954.50	
	ENEL CHILE SA	364,877	33.900	12,369,330.30	
	チリ・ペソ小計	4,284,163		867,599,434.68 (136,195,759)	
コロンビア・ペソ	ECOPETROL SA	134,524	2,332.000	313,709,968.00	
	BANCOLOMBIA SA	5,994	33,510.000	200,858,940.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	12,217	31,480.000	384,591,160.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	8,110	16,900.000	137,059,000.00	
	コロンビア・ペソ小計	160,845		1,036,219,068.00 (33,975,551)	
インド・ルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	21,390	338.500	7,240,515.00	
	COAL INDIA LTD	37,979	237.600	9,023,810.40	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	15,734	245.850	3,868,203.90	
	INDIAN OIL CORP LTD	66,526	72.550	4,826,461.30	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	62,021	134.000	8,310,814.00	

PETRONET LNG LTD	18,486	217.850	4,027,175.10
RELIANCE INDUSTRIES LTD	75,244	2,569.300	193,324,409.20
ACC LTD	1,628	2,365.600	3,851,196.80
AMBUJA CEMENTS LTD	16,248	454.700	7,387,965.60
ASIAN PAINTS LTD	9,511	3,441.850	32,735,435.35
BERGER PAINTS INDIA LTD	6,933	664.000	4,603,512.00
GRASIM INDUSTRIES LTD	6,476	1,748.250	11,321,667.00
HINDALCO INDUSTRIES LTD	34,596	426.000	14,737,896.00
JINDAL STEEL & POWER LTD	8,561	430.950	3,689,362.95
JSW STEEL LTD	18,789	686.950	12,907,103.55
PI INDUSTRIES LTD	1,869	3,241.400	6,058,176.60
PIDILITE INDUSTRIES LTD	3,991	2,844.150	11,351,002.65
SHREE CEMENT LTD	295	24,505.600	7,229,152.00
SRF LTD	3,336	2,639.250	8,804,538.00
TATA STEEL LTD	180,637	105.700	19,093,330.90
ULTRATECH CEMENT LTD	2,491	6,783.650	16,898,072.15
UPL LTD	12,873	742.000	9,551,766.00
VEDANTA LTD	15,567	266.650	4,150,940.55
ADANI ENTERPRISES LTD	7,025	3,451.200	24,244,680.00
BHARAT ELECTRONICS LTD	30,032	328.150	9,855,000.80
HAVELLS INDIA LTD	5,714	1,346.100	7,691,615.40
LARSEN & TOUBRO LTD	17,309	1,949.750	33,748,222.75
SIEMENS LTD	1,495	2,925.150	4,373,099.25
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	6,819	711.800	4,853,764.20
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	13,018	906.850	11,805,373.30
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	6,593	752.700	4,962,551.10
INTERGLOBE AVIATION LTD	2,035	1,933.300	3,934,265.50
BAJAJ AUTO LTD	1,601	3,848.600	6,161,608.60
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	1,906	1,989.800	3,792,558.80
BHARAT FORGE LTD	5,374	787.650	4,232,831.10
EICHER MOTORS LTD	3,370	3,473.150	11,704,515.50
HERO MOTOCORP LTD	2,709	2,838.450	7,689,361.05
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	21,636	1,301.250	28,153,845.00
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,979	8,946.000	26,650,134.00
MRF LTD	47	84,208.050	3,957,778.35
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	33,404	123.700	4,132,074.80
TATA MOTORS LTD	40,931	445.900	18,251,132.90
PAGE INDUSTRIES LTD	151	48,961.800	7,393,231.80
TITAN CO LTD	8,754	2,603.450	22,790,601.30
JUBILANT FOODWORKS LTD	9,393	601.000	5,645,193.00
TRENT LTD	4,308	1,379.350	5,942,239.80
ZOMATO LTD	58,211	62.800	3,655,650.80
AVENUE SUPERMARTS LTD	3,992	4,386.100	17,509,311.20
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	2,672	3,649.500	9,751,464.00

ITC LTD	72,909	330.500	24,096,424.50	
MARICO LTD	13,955	521.700	7,280,323.50	
NESTLE INDIA LTD	832	19,051.250	15,850,640.00	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	13,630	816.300	11,126,169.00	
UNITED SPIRITS LTD	7,165	808.150	5,790,394.75	
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	2,569	1,634.850	4,199,929.65	
DABUR INDIA LTD	16,354	574.900	9,401,914.60	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	10,773	938.000	10,105,074.00	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	20,515	2,588.700	53,107,180.50	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	2,481	4,460.350	11,066,128.35	
AUROBINDO PHARMA LTD	6,499	542.300	3,524,407.70	
BIOCON LTD	10,292	302.150	3,109,727.80	
CIPLA LTD	11,934	1,058.300	12,629,752.20	
DIVI'S LABORATORIES LTD	3,272	3,603.000	11,789,016.00	
DR. REDDY'S LABORATORIES	2,872	4,255.100	12,220,647.20	
LUPIN LTD	4,861	668.550	3,249,821.55	
PIRAMAL PHARMA LTD	9,756	219.124	2,137,773.74	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	23,658	890.000	21,055,620.00	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	2,503	1,523.400	3,813,070.20	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	3,304	652.600	2,156,190.40	
AXIS BANK LTD	56,886	784.850	44,646,977.10	
BANDHAN BANK LTD	13,522	293.500	3,968,707.00	
ICICI BANK LTD	127,560	901.250	114,963,450.00	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	13,704	1,926.350	26,398,700.40	
STATE BANK OF INDIA	44,000	553.350	24,347,400.00	
YES BANK LTD	277,899	17.500	4,863,232.50	
BAJAJ FINANCE LTD	6,716	7,180.900	48,226,924.40	
BAJAJ FINSERV LTD	941	17,205.650	16,190,516.65	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	10,122	790.750	8,003,971.50	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	42,746	2,431.500	103,936,899.00	
MUTHOOT FINANCE LTD	2,968	1,045.350	3,102,598.80	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	4,949	943.250	4,668,144.25	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	4,668	1,324.100	6,180,898.80	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	23,440	575.950	13,500,268.00	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	5,930	1,221.300	7,242,309.00	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	7,542	585.050	4,412,447.10	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	11,098	1,297.450	14,399,100.10	
DLF LTD	15,255	396.900	6,054,709.50	
GODREJ PROPERTIES LTD	3,083	1,409.500	4,345,488.50	
HCL TECHNOLOGIES LTD	26,758	948.500	25,379,963.00	
INFOSYS LTD	83,406	1,511.650	126,080,679.90	
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	1,236	4,673.600	5,776,569.60	
MINDTREE LTD	1,384	3,309.450	4,580,278.80	
MPHASIS LTD	1,773	2,144.850	3,802,819.05	

	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	22,550	3,217.650	72,558,007.50	
	TATA ELXSI LTD	844	8,816.800	7,441,379.20	
	TECH MAHINDRA LTD	14,379	1,126.650	16,200,100.35	
	WIPRO LTD	33,678	417.150	14,048,777.70	
	BHARTI AIRTEL LTD	55,035	765.750	42,143,051.25	
	INDUS TOWERS LTD	16,890	203.700	3,440,493.00	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	7,809	2,315.900	18,084,863.10	
	ADANI POWER LTD	19,015	397.000	7,548,955.00	
	ADANI TOTAL GAS LTD	6,778	3,633.300	24,626,507.40	
	ADANI TRANSMISSION LTD	7,036	3,931.100	27,659,219.60	
	GAIL INDIA LTD	48,927	92.400	4,520,854.80	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	6,611	418.800	2,768,686.80	
	NTPC LTD	95,615	166.600	15,929,459.00	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	77,378	222.900	17,247,556.20	
	TATA POWER CO LTD	35,446	242.350	8,590,338.10	
	INFO EDGE INDIA LTD	1,749	4,284.350	7,493,328.15	
	インド・ルピー小計	2,390,119		1,840,959,447.04 (3,313,727,005)	
インドネ シア・ル ピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBK P	354,800	3,950.000	1,401,460,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	38,700	34,300.000	1,327,410,000.00	
	ADARO MINERALS INDONESIA TBK	171,600	1,680.000	288,288,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	128,000	1,975.000	252,800,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	626,800	870.000	545,316,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	57,500	9,525.000	547,687,500.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	325,161	3,940.000	1,281,134,340.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	91,200	6,600.000	601,920,000.00	
	VALE INDONESIA TBK	52,100	6,175.000	321,717,500.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	516,000	6,775.000	3,495,900,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	410,100	2,110.000	865,311,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	175,400	5,875.000	1,030,475,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	10,800	23,700.000	255,960,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	71,100	8,450.000	600,795,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	87,700	6,225.000	545,932,500.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	182,700	4,500.000	822,150,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	520,000	1,700.000	884,000,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,382,000	8,375.000	11,574,250,000.00	
	BANK JAGO TBK PT	102,500	7,825.000	802,062,500.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	460,200	9,075.000	4,176,315,000.00	
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	183,900	8,800.000	1,618,320,000.00		
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	1,709,100	4,610.000	7,878,951,000.00		
SARANA MENARA NUSANTARA PT	516,500	1,245.000	643,042,500.00		
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	1,229,700	4,600.000	5,656,620,000.00		
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	118,900	2,900.000	344,810,000.00		
	インドネシア・ルピア小計	9,522,461		47,762,627,840.00	

				(463,297,490)	
ブラジ ル・レア ル	COSAN SA	29,988	18.880	566,173.44	
	PETRO RIO SA	17,400	28.050	488,070.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	91,700	35.480	3,253,516.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	117,400	31.790	3,732,146.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	17,600	13.510	237,776.00	
	BRASKEM SA-PREF A	4,000	30.910	123,640.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	14,600	14.110	206,006.00	
	GERDAU SA-PREF	29,900	24.540	733,746.00	
	SUZANO SA	19,315	45.110	871,299.65	
	VALE SA	98,688	69.550	6,863,750.40	
	WEG SA	41,360	30.450	1,259,412.00	
	CCR SA	32,700	14.400	470,880.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	18,930	63.270	1,197,701.10	
	RUMO SA	34,000	20.730	704,820.00	
	AMERICANAS SA	13,024	16.560	215,677.44	
	LOJAS RENNER S.A.	24,358	26.850	654,012.30	
	MAGAZINE LUIZA SA	74,900	4.380	328,062.00	
	VIBRA ENERGIA SA	28,680	18.410	527,998.80	
	ATACADAO SA	14,200	20.550	291,810.00	
	RAIA DROGASIL SA	24,200	22.750	550,550.00	
	AMBEV SA	116,500	15.720	1,831,380.00	
	BRF SA	15,000	16.070	241,050.00	
	JBS SA	18,400	27.940	514,096.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	22,100	16.160	357,136.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	114,419	8.130	930,226.47	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	9,900	34.090	337,491.00	
	HYPERA SA	10,100	43.620	440,562.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	39,481	16.000	631,696.00	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	133,536	19.380	2,587,927.68	
	BANCO DO BRASIL S.A.	21,200	40.550	859,660.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	121,000	26.750	3,236,750.00	
	ITAUSA SA	114,369	9.330	1,067,062.77	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	153,600	12.950	1,989,120.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	17,300	28.560	494,088.00	
	TOTVS SA	12,900	29.260	377,454.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	11,300	42.790	483,527.00	
TIM SA	18,200	12.790	232,778.00		
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	26,805	45.340	1,215,338.70		
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	5,700	46.660	265,962.00		
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	34,299	12.140	416,389.86		
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	9,300	53.040	493,272.00		
CPFL ENERGIA SA	4,800	35.190	168,912.00		
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	4,250	40.360	171,530.00		

	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	22,800	24.500	558,600.00	
	ブラジル・リアル小計	1,804,202		43,179,056.61 (1,197,325,013)	
チェコ・ コロナ	KOMERCNI BANKA AS	1,821	638.000	1,161,798.00	
	MONETA MONEY BANK AS	4,790	76.900	368,351.00	
	CEZ AS	4,177	935.000	3,905,495.00	
	チェコ・コロナ小計	10,788		5,435,644.00 (31,857,766)	
韓国・ ウォン	HD HYUNDAI	1,340	60,000.000	80,400,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	1,368	189,500.000	259,236,000.00	
	S-OIL CORP	1,213	97,100.000	117,782,300.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	2,623	53,900.000	141,379,700.00	
	HYUNDAI STEEL CO	1,821	32,900.000	59,910,900.00	
	KOREA ZINC CO LTD	227	615,000.000	139,605,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	531	127,000.000	67,437,000.00	
	LG CHEM LTD	1,232	644,000.000	793,408,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	227	296,000.000	67,192,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	360	176,000.000	63,360,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	641	169,000.000	108,329,000.00	
	POSCO HOLDINGS INC	1,934	241,500.000	467,061,000.00	
	SK CHEMICALS CO LTD	144	105,000.000	15,120,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	526	76,600.000	40,291,600.00	
	SKC CO LTD	496	111,000.000	55,056,000.00	
	CJ CORP	498	74,400.000	37,051,200.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	1,293	32,700.000	42,281,100.00	
	DOOSAN ENERBILITY CO LTD	10,618	17,800.000	189,000,400.00	
	ECOPRO BM CO LTD	1,290	108,000.000	139,320,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	1,373	28,200.000	38,718,600.00	
	GS HOLDINGS	1,178	45,400.000	53,481,200.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	1,849	43,500.000	80,431,500.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	448	127,000.000	56,896,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,568	55,500.000	87,024,000.00	
	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	1,158	88,100.000	102,019,800.00	
	LG CORP	2,459	78,000.000	191,802,000.00	
	LG ENERGY SOLUTION	600	486,500.000	291,900,000.00	
	SAMSUNG C&T CORP	2,163	116,000.000	250,908,000.00	
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	4,316	22,650.000	97,757,400.00	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	14,496	5,660.000	82,047,360.00	
	SK INC	961	219,500.000	210,939,500.00	
	S-1 CORPORATION	219	56,600.000	12,395,400.00	
CJ LOGISTICS	235	113,500.000	26,672,500.00		
HMM CO LTD	7,125	20,000.000	142,500,000.00		
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	524	166,000.000	86,984,000.00		
KOREAN AIR LINES CO LTD	4,701	25,300.000	118,935,300.00		

PAN OCEAN CO LTD	4,527	4,830.000	21,865,410.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	2,114	41,050.000	86,779,700.00	
HANON SYSTEMS	4,138	11,050.000	45,724,900.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	1,515	219,500.000	332,542,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO	3,424	200,000.000	684,800,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	863	94,600.000	81,639,800.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	582	93,500.000	54,417,000.00	
KIA CORP	6,495	80,900.000	525,445,500.00	
COWAY CO LTD	1,284	58,700.000	75,370,800.00	
F&F CO LTD / NEW	502	146,500.000	73,543,000.00	
HLB INC	2,599	51,800.000	134,628,200.00	
LG ELECTRONICS INC	2,622	93,800.000	245,943,600.00	
KANGWON LAND INC	2,078	25,550.000	53,092,900.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	680	71,000.000	48,280,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	172	97,700.000	16,804,400.00	
BGF RETAIL CO LTD	193	158,500.000	30,590,500.00	
E-MART INC	516	96,700.000	49,897,200.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	174	390,000.000	67,860,000.00	
KT&G CORP	2,707	83,200.000	225,222,400.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	694	96,800.000	67,179,200.00	
AMOREPACIFIC CORP	808	117,500.000	94,940,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	473	33,450.000	15,821,850.00	
LG H&H	231	655,000.000	151,305,000.00	
LG H&H-PRF	35	349,500.000	12,232,500.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	2,295	70,800.000	162,486,000.00	
SD BIOSENSOR INC	604	31,800.000	19,207,200.00	
ALTEOGEN INC	735	59,000.000	43,365,000.00	
CELLTRION INC	2,486	184,000.000	457,424,000.00	
CELLTRION PHARM INC	347	74,000.000	25,678,000.00	
GREEN CROSS CORP	79	149,000.000	11,771,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	171	302,000.000	51,642,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	452	810,000.000	366,120,000.00	
SEEGENE INC	713	30,350.000	21,639,550.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	657	68,200.000	44,807,400.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	550	107,500.000	59,125,000.00	
YUHAN CORP	1,226	55,600.000	68,165,600.00	
HANA FINANCIAL GROUP	7,294	37,000.000	269,878,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	5,467	9,450.000	51,663,150.00	
KAKAOBANK CORP	2,498	25,000.000	62,450,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	9,657	48,200.000	465,467,400.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	11,380	35,050.000	398,869,000.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	13,459	11,350.000	152,759,650.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	873	54,400.000	47,491,200.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	824	25,450.000	20,970,800.00	

	MERITZ SECURITIES CO LTD	5,528	4,530.000	25,041,840.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	8,457	6,860.000	58,015,020.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	2,376	9,610.000	22,833,360.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	1,312	32,750.000	42,968,000.00	
	DB INSURANCE CO LTD	912	59,200.000	53,990,400.00	
	MERITZ FIRE & MARINE INSURAN	969	35,250.000	34,157,250.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	759	192,000.000	145,728,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	2,148	64,500.000	138,546,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	942	122,500.000	115,395,000.00	
	ILJIN MATERIALS CO LTD	385	66,600.000	25,641,000.00	
	L&F CO LTD	576	227,000.000	130,752,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	4,881	15,200.000	74,191,200.00	
	LG INNOTEK CO LTD	382	337,500.000	128,925,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1,381	137,500.000	189,887,500.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	117,729	55,600.000	6,545,732,400.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	20,285	52,000.000	1,054,820,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	1,371	571,000.000	782,841,000.00	
	SK HYNIX INC	13,459	90,400.000	1,216,693,600.00	
	SK SQUARE CO LTD	2,713	42,100.000	114,217,300.00	
	LG UPLUS CORP	4,555	11,200.000	51,016,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	5,778	19,650.000	113,537,700.00	
	CHEIL WORLDWIDE INC	1,193	22,250.000	26,544,250.00	
	CJ ENM CO LTD	144	91,000.000	13,104,000.00	
	HYBE CO LTD	459	158,000.000	72,522,000.00	
	KAKAO CORP	7,811	68,000.000	531,148,000.00	
	KAKAO GAMES CORP	734	49,200.000	36,112,800.00	
	KRAFTON INC	650	237,000.000	154,050,000.00	
	NAVER CORP	3,280	231,500.000	759,320,000.00	
	NCSOFT CORP	406	371,500.000	150,829,000.00	
	NETMARBLE CORP	337	61,500.000	20,725,500.00	
	PEARL ABYSS CORP	498	55,000.000	27,390,000.00	
	韓国・ウォン小計	387,358		23,668,215,190.00 (2,452,027,094)	
マレーシ ア・リン ギット	DIALOG GROUP BHD	90,500	2.230	201,815.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	7,300	21.580	157,534.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	63,200	8.940	565,008.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	82,100	5.000	410,500.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	20,400	7.000	142,800.00	
	SIME DARBY BERHAD	47,100	2.230	105,033.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	14,700	5.970	87,759.00	
	MISC BHD	28,500	7.150	203,775.00	
	GENTING BHD	60,200	4.600	276,920.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	73,100	3.000	219,300.00	
	MR DIY GROUP M BHD	63,450	2.130	135,148.50	

	IOI CORP BHD	70,600	4.080	288,048.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	8,600	22.320	191,952.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	1,500	131.900	197,850.00	
	PPB GROUP BERHAD	13,340	16.780	223,845.20	
	QL RESOURCES BHD	29,250	5.060	148,005.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	59,300	4.270	253,211.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	37,700	1.620	61,074.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	41,700	6.170	257,289.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	97,900	0.795	77,830.50	
	AMMB HOLDINGS BHD	39,300	4.060	159,558.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	172,800	5.440	940,032.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	16,000	20.880	334,080.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	5,700	19.300	110,010.00	
	MALAYAN BANKING BHD	122,000	8.970	1,094,340.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	366,600	4.690	1,719,354.00	
	RHB BANK BHD	28,900	5.760	166,464.00	
	INARI AMERTRON BHD	52,900	2.750	145,475.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	52,900	2.930	154,997.00	
	DIGI.COM BHD	86,400	3.600	311,040.00	
	MAXIS BHD	57,900	3.840	222,336.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	34,000	5.810	197,540.00	
	PETRONAS GAS BHD	21,600	17.100	369,360.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	67,600	8.750	591,500.00	
	マレーシア・リンギット小計	2,035,040		10,720,783.20 (340,264,794)	
南アフリ カ・ラン ド	EXXARO RESOURCES LTD	6,027	231.050	1,392,538.35	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	2,473	263.410	651,412.93	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	1,308	1,235.090	1,615,497.72	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	10,879	240.180	2,612,918.22	
	GOLD FIELDS LTD	22,932	143.610	3,293,264.52	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	11,645	38.190	444,722.55	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	20,959	191.800	4,019,936.20	
	KUMBA IRON ORE LTD	1,588	390.000	619,320.00	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	8,310	166.260	1,381,620.60	
	SASOL LTD	13,960	322.210	4,498,051.60	
	SIBANYE STILLWATER LTD	73,151	41.460	3,032,840.46	
	BIDVEST GROUP LTD	7,735	221.900	1,716,396.50	
	MR PRICE GROUP LTD	6,331	196.680	1,245,181.08	
	NASPERS LTD-N SHS	5,394	2,491.770	13,440,607.38	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	35,012	21.500	752,758.00	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	6,946	137.410	954,449.86	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	24,638	64.440	1,587,672.72	
BID CORP LTD	8,268	316.700	2,618,475.60		
CLICKS GROUP LTD	6,014	304.630	1,832,044.82		

	SHOPRITE HOLDINGS LTD	12,962	224.400	2,908,672.80	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	4,180	154.520	645,893.60	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	9,393	154.610	1,452,251.73	
	ABSA GROUP LTD	19,853	187.510	3,722,636.03	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	2,146	1,904.320	4,086,670.72	
	NEDBANK GROUP LTD	11,348	212.000	2,405,776.00	
	STANDARD BANK GROUP LTD	33,094	155.610	5,149,757.34	
	FIRSTRAND LTD	124,451	65.200	8,114,205.20	
	REINET INVESTMENTS SCA	2,879	296.950	854,919.05	
	REMGRO LTD	13,046	134.090	1,749,338.14	
	DISCOVERY LTD	12,309	110.000	1,353,990.00	
	OLD MUTUAL LTD	116,070	10.700	1,241,949.00	
	SANLAM LTD	43,917	55.050	2,417,630.85	
	NEPI ROCKCASTLE S.A.	11,259	91.300	1,027,946.70	
	MTN GROUP LTD	42,837	133.790	5,731,162.23	
	VODACOM GROUP LTD	16,889	130.470	2,203,507.83	
	MULTICHOICE GROUP LTD	7,894	111.820	882,707.08	
	南アフリカ・ランド小計	758,097		93,658,723.41 (772,684,468)	
タイ・ パーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	34,300	163.000	5,590,900.00	
	PTT PCL-NVDR	252,400	36.750	9,275,700.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	24,800	56.250	1,395,000.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	35,700	41.750	1,490,475.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	61,700	44.750	2,761,075.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	27,300	55.250	1,508,325.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	19,200	354.000	6,796,800.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	105,600	72.500	7,656,000.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR	221,600	9.150	2,027,640.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	229,500	8.650	1,985,175.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	184,500	5.650	1,042,425.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	72,700	30.250	2,199,175.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	36,791	40.750	1,499,233.25	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	166,900	14.000	2,336,600.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	72,100	27.500	1,982,750.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	19,000	34.250	650,750.00	
	CP ALL PCL-NVDR	148,700	60.000	8,922,000.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	5,400	99.000	534,600.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	106,800	26.000	2,776,800.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	38,500	30.750	1,183,875.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	58,800	17.000	999,600.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	254,600	29.750	7,574,350.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	14,700	224.000	3,292,800.00	
KASIKORNBANK PCL-NVDR	16,500	149.000	2,458,500.00		
KRUNG THAI BANK - NVDR	103,500	16.800	1,738,800.00		

	SCB X PCL-NVDR	23,400	111.500	2,609,100.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	43,300	18.100	783,730.00	
	JMT NETWORK SERVICES-NVDR	16,600	77.500	1,286,500.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	27,100	60.500	1,639,550.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	16,200	42.500	688,500.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	11,800	48.750	575,250.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	46,300	68.250	3,159,975.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	176,900	8.950	1,583,255.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	7,700	668.000	5,143,600.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	29,300	192.500	5,640,250.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	27,000	74.000	1,998,000.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	259,200	4.740	1,228,608.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	20,900	37.750	788,975.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	5,500	179.000	984,500.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	44,900	87.000	3,906,300.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	14,800	69.250	1,024,900.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	78,100	56.500	4,412,650.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	19,600	43.000	842,800.00	
	タイ・パーツ小計	3,180,191		117,975,791.25 (462,465,102)	
ポーランド・ズロチ	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	10,357	57.320	593,663.24	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	36,383	5.292	192,538.83	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	3,845	92.940	357,354.30	
	LPP SA	23	8,675.000	199,525.00	
	ALLEGRO.EU SA	10,674	26.000	277,524.00	
	DINO POLSKA SA	1,310	345.100	452,081.00	
	BANK PEKAO SA	3,856	68.580	264,444.48	
	MBANK SA	302	245.800	74,231.60	
	PKO BANK POLSKI SA	23,204	24.290	563,625.16	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	751	217.000	162,967.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	16,272	27.730	451,222.56	
	ORANGE POLSKA SA	15,737	5.832	91,778.18	
	PGE SA	19,508	7.628	148,807.02	
	CD PROJEKT SA	1,469	87.800	128,978.20	
CYFROWY POLSAT SA	5,742	19.250	110,533.50		
	ポーランド・ズロチ小計	149,433		4,069,274.07 (124,768,419)	
ハンガリー・フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	8,186	2,650.000	21,692,900.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	2,331	7,720.000	17,995,320.00	
	OTP BANK PLC	4,109	8,636.000	35,485,324.00	
	ハンガリー・フォリント小計	14,626		75,173,544.00 (27,300,925)	
ユーロ	MYTILINEOS S.A.	2,326	14.470	33,657.22	
	FF GROUP	123	4.800	590.40	

OPAP SA	4,784	13.100	62,670.40	
JUMBO SA	2,851	13.600	38,773.60	
ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	53,592	0.914	48,983.08	
EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	64,000	0.908	58,112.00	
NATIONAL BANK OF GREECE	13,389	3.325	44,518.42	
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	5,406	15.860	85,739.16	
PUBLIC POWER CORP	4,579	5.340	24,451.86	
ユーロ小計	151,050		397,496.14 (57,171,870)	
合計	56,721,526		19,267,678,516 (19,267,678,516)	

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

通貨	銘柄数		組入株式時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	株式	31銘柄	3.1%	3.9%
香港・ドル	株式	196銘柄	21.8%	27.6%
台湾・ドル	株式	87銘柄	12.9%	16.3%
エジプト・ポンド	株式	3銘柄	0.1%	0.1%
トルコ・リラ	株式	12銘柄	0.4%	0.5%
メキシコ・ペソ	株式	17銘柄	1.6%	2.0%
フィリピン・ペソ	株式	20銘柄	0.7%	0.9%
チリ・ペソ	株式	12銘柄	0.6%	0.7%
コロンビア・ペソ	株式	4銘柄	0.1%	0.2%
インド・ルピー	株式	109銘柄	13.6%	17.2%
インドネシア・ルピア	株式	25銘柄	1.9%	2.4%
ブラジル・リアル	株式	44銘柄	4.9%	6.2%
チェコ・コルナ	株式	3銘柄	0.1%	0.2%
韓国・ウォン	株式	111銘柄	10.0%	12.7%
マレーシア・リングgit	株式	34銘柄	1.4%	1.8%
南アフリカ・ランド	株式	36銘柄	3.2%	4.0%
タイ・バーツ	株式	43銘柄	1.9%	2.4%
ポーランド・ズロチ	株式	15銘柄	0.5%	0.6%
ハンガリー・フォリント	株式	3銘柄	0.1%	0.1%
ユーロ	株式	9銘柄	0.2%	0.3%

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オフショア・人民元	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	1,403,800.00	58,819,220.00	
		オフショア・人民元小計	1,403,800.00	58,819,220.00 (1,211,446,537)	
投資信託受益証券合計				1,211,446,537 (1,211,446,537)	
投資証券		ISHARES MSCI KUWAIT ETF	37,235.00	1,343,811.15	

アメリカ・ドル	ISHARES MSCI QATAR ETF	82,108.00	1,802,845.35	
	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	166,080.00	7,163,030.40	
	ISHARES MSCI UAE ETF	130,807.00	2,020,968.15	
アメリカ・ドル小計		416,230.00	12,330,655.05 (1,761,064,154)	
メキシコ・ペソ	CEMEX SAB-CPO	393,600.00	3,101,568.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	12,945.00	1,616,830.50	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	47,900.00	6,308,909.00	
	GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	54,100.00	1,379,009.00	
	TRUST FIBRA UNO	66,400.00	1,406,352.00	
メキシコ・ペソ小計		574,945.00	13,812,668.50 (99,313,087)	
ブラジル・リアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	29,100.00	765,330.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	7,800.00	235,326.00	
	ENERGISA SA-UNITS	4,800.00	211,008.00	
	KLABIN SA - UNIT	17,500.00	326,725.00	
ブラジル・リアル小計		59,200.00	1,538,389.00 (42,658,450)	
南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	72,006.00	943,278.60	
	南アフリカ・ランド小計		72,006.00	943,278.60 (7,782,048)
投資証券合計			1,910,817,739 (1,910,817,739)	
合計			3,122,264,276 (3,122,264,276)	

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

通貨	銘柄数		組入 投資信託受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券	4銘柄	-	7.2%	56.4%
メキシコ・ペソ	投資証券	5銘柄	-	0.4%	3.2%
ブラジル・リアル	投資証券	4銘柄	-	0.2%	1.4%
オフショア・人民元	投資信託受益証券	1銘柄	5.0%	-	38.8%
南アフリカ・ランド	投資証券	1銘柄	-	0.0%	0.2%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

Jリート・インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

(2021年9月10日現在)

(2022年9月12日現在)

資産の部

流動資産		
金銭信託	13,069,994	1,734,473
コール・ローン	25,323,242	48,750,235
投資証券	7,331,509,060	9,847,729,000
派生商品評価勘定	-	283,600
未収配当金	84,752,506	114,103,009
前払金	684,000	-
差入委託証拠金	1,840,000	2,350,000
流動資産合計	7,457,178,802	10,014,950,317
資産合計		
	7,457,178,802	10,014,950,317
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	688,400	-
前受金	-	208,000
未払金	4,641,868	-
未払解約金	11,006,893	729,780
未払利息	55	-
その他未払費用	1,762	479
流動負債合計	16,338,978	938,259
負債合計		
	16,338,978	938,259
純資産の部		
元本等		
元本	2,675,035,456	3,618,768,466
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	4,765,804,368	6,395,243,592
元本等合計	7,440,839,824	10,014,012,058
純資産合計		
	7,440,839,824	10,014,012,058
負債純資産合計		
	7,457,178,802	10,014,950,317

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2021年9月11日 至 2022年9月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p>

	(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年9月10日現在)	(2022年9月12日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,675,035,456口	3,618,768,466口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.7816円 (1万口当たりの純資産額27,816円)	1口当たり純資産額 2.7672円 (1万口当たりの純資産額27,672円)

(金融商品に関する注記)

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年9月11日 至 2022年9月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

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

・金融商品の時価等に関する事項

項 目	(2022年9月12日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券（投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年9月10日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

		契 約 額 等		
--	--	---------	--	--

区 分	種 類		うち	時 価	評 価 損 益
			1 年 超		
市場取引	リート指数先物取引 買建				
	TREIT 先物	42,968,400	-	42,280,000	688,400
	小計	42,968,400	-	42,280,000	688,400
合 計		42,968,400	-	42,280,000	688,400

(2022年9月12日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち		
			1 年 超		
市場取引	リート指数先物取引 買建				
	TREIT 先物 0412月	40,146,400	-	40,430,000	283,600
	小計	40,146,400	-	40,430,000	283,600
合 計		40,146,400	-	40,430,000	283,600

(注) 1. 時価の算定方法

リート指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2)リート指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2021年9月11日 至 2022年9月12日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2021年9月10日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	3,156,320,526円
同期中における追加設定元本額	1,804,469,684円
同期中における一部解約元本額	2,285,754,754円
2021年9月10日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	78,052,871円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	146,589,272円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	115,566,389円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	1,711,377,137円

三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	11,564,038円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	41,617,020円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	30,947,562円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	98,284,108円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	50,373,063円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	40,646,760円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	17,827,319円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,565,187円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	43,998,485円
日興FWS・Jリートインデックス	357,488円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	575,069円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	4,420,651円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	8,702,519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>	26,259,893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>	55,546,231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>	59,826,581円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%)<適格機関投資家限定>	130,937,813円
合計	2,675,035,456円

(2022年9月12日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	2,675,035,456円
同期中における追加設定元本額	2,538,256,373円
同期中における一部解約元本額	1,594,523,363円
2022年9月12日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	69,933,114円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	138,890,778円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	107,176,523円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	2,119,488,327円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	16,140,629円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	57,002,092円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	42,983,263円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	148,291,027円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	83,664,634円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	65,470,159円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	28,910,457円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,245,677円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	85,939,337円
日興FWS・Jリートインデックス	305,206,603円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	20,225,759円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	3,493,800円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	63,085,945円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	48,115,503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>	61,060,756円

SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%)<適

格機関投資家限定>

151,444,083円

合計

3,618,768,466円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	174	21,019,200	
	サンケイリアルエステート投資法人	276	27,103,200	
	S O S I L A 物流リート投資法人	410	64,288,000	
	東海道リート投資法人	102	12,576,600	
	日本アコモデーションファンド投資法人	301	207,088,000	
	森ヒルズリート投資法人	1,024	162,713,600	
	産業ファンド投資法人	1,303	243,139,800	
	アドバンス・レジデンス投資法人	871	318,786,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	626	141,789,000	
	アクティブ・プロパティーズ投資法人	459	200,812,500	
	GLP投資法人	2,683	449,939,100	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	406	137,431,000	
	日本プロロジスリート投資法人	1,428	501,942,000	
	星野リゾート・リート投資法人	153	98,226,000	
	Oneリート投資法人	152	41,632,800	
	イオンリート投資法人	966	154,849,800	
	ヒューリックリート投資法人	816	139,944,000	
	日本リート投資法人	283	108,389,000	
	積水ハウス・リート投資法人	2,652	224,094,000	
	トーセイ・リート投資法人	192	26,995,200	
	ケネディクス商業リート投資法人	366	104,127,000	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	213	39,426,300	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	219	27,900,600	
	野村不動産マスターファンド投資法人	2,819	470,209,200	
いちごホテルリート投資法人	140	13,650,000		
ラサールロジポート投資法人	1,069	184,509,400		
スターアジア不動産投資法人	1,084	64,281,200		
マリモ地方創生リート投資法人	107	14,348,700		
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	345	186,990,000		
大江戸温泉リート投資法人	135	9,085,500		

投資法人みらい	1,065	54,847,500	
森トラスト・ホテルリート投資法人	202	26,280,200	
三菱地所物流リート投資法人	268	128,640,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	337	71,814,700	
ザイマックス・リート投資法人	138	17,526,000	
タカラレーベン不動産投資法人	380	41,116,000	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	340	54,094,000	
日本ビルファンド投資法人	1,016	690,880,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	871	564,408,000	
日本都市ファンド投資法人	4,398	476,303,400	
オリックス不動産投資法人	1,737	332,461,800	
日本プライムリアルティ投資法人	596	244,658,000	
N T T 都市開発リート投資法人	840	126,756,000	
東急リアル・エステート投資法人	585	116,590,500	
グローバル・ワン不動産投資法人	599	67,267,700	
ユナイテッド・アーバン投資法人	1,963	299,161,200	
森トラスト総合リート投資法人	625	90,875,000	
インヴィンシブル投資法人	3,844	169,136,000	
フロンティア不動産投資法人	323	174,420,000	
平和不動産リート投資法人	597	93,191,700	
日本ロジスティクスファンド投資法人	588	196,392,000	
福岡リート投資法人	451	76,715,100	
ケネディクス・オフィス投資法人	256	183,040,000	
いちごオフィスリート投資法人	718	62,825,000	
大和証券オフィス投資法人	179	127,090,000	
阪急阪神リート投資法人	396	62,290,800	
スターツプロシード投資法人	134	34,947,200	
大和ハウスリート投資法人	1,313	419,503,500	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	2,815	197,050,000	
大和証券リビング投資法人	1,161	141,409,800	
ジャパンエクセレント投資法人	802	108,751,200	
投資証券 小計		9,847,729,000	
合 計		9,847,729,000	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

外国リート・インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2021年9月10日現在)	(2022年9月12日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	107,044,462	141,283,164

金銭信託	4,135,433	1,988,582
コール・ローン	8,012,441	55,892,399
投資証券	15,206,331,216	25,792,800,161
派生商品評価勘定	1,159	84,452
未収入金	232,149	1,725,836
未収配当金	19,823,199	46,375,941
流動資産合計	15,345,580,059	26,040,150,535
資産合計	15,345,580,059	26,040,150,535
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	13,113	343,991
未払金	56,100,512	7,135,212
未払解約金	734,905	20,688,744
未払利息	17	-
その他未払費用	452	335
流動負債合計	56,848,999	28,168,282
負債合計	56,848,999	28,168,282
純資産の部		
元本等		
元本	5,775,124,200	8,375,587,967
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	9,513,606,860	17,636,394,286
元本等合計	15,288,731,060	26,011,982,253
純資産合計	15,288,731,060	26,011,982,253
負債純資産合計	15,345,580,059	26,040,150,535

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2021年9月11日 至 2022年9月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年9月10日現在)	(2022年9月12日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	5,775,124,200口	8,375,587,967口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.6473円 (1万口当たりの純資産額26,473円)	1口当たり純資産額 3.1057円 (1万口当たりの純資産額31,057円)

(金融商品に関する注記)

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年9月11日 至 2022年9月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

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

・金融商品の時価等に関する事項

項 目	(2022年9月12日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年9月10日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

		契 約 額 等	
--	--	---------	--

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち 1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	15,000,000	-	15,000,861	861
	イギリス・ポンド	1,250,000	-	1,250,098	98
	オーストラリア・ド ル	5,150,000	-	5,145,370	4,630
	ユーロ	1,000,000	-	1,000,084	84
	香港・ドル	2,200,000	-	2,191,633	8,367
	小計	24,600,000	-	24,588,046	11,954
合 計	24,600,000	-	24,588,046	11,954	

(2022年9月12日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち 1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	50,900,000	-	50,566,235	333,765
	オーストラリア・ド ル	2,000,000	-	2,007,723	7,723
	シンガポール・ドル	1,200,000	-	1,193,095	6,905
	イギリス・ポンド	2,100,000	-	2,096,944	3,056
	小計	56,200,000	-	55,863,997	336,003
	売建				
	アメリカ・ドル	11,500,000	-	11,423,536	76,464
	小計	11,500,000	-	11,423,536	76,464
	合 計	67,700,000	-	67,287,533	259,539

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2021年9月11日 至 2022年9月12日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2021年9月10日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	4,109,013,318円
同期中における追加設定元本額	2,539,203,377円
同期中における一部解約元本額	873,092,495円
2021年9月10日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	20,163,828円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	21,022,305円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	13,874,376円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	5,035,048,237円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	4,280,108円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	44,209,437円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	32,511,723円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	103,143,968円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	53,161,543円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	42,723,437円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	56,813,655円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	578,654円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド	82,353,208円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	378,061円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	381,491円
三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド	419,897円
S M A M・世界リート・インデックスファンドV A <適格機関投資家限定>	47,609,004円
S M A M・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	13,755,435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>	34,135,132円
S M D A M・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%)<適格機関投資家限定>	168,560,701円
合 計	5,775,124,200円

(2022年9月12日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	5,775,124,200円
同期中における追加設定元本額	3,433,415,780円
同期中における一部解約元本額	832,952,013円
2022年9月12日現在の元本の内訳	

アセットアロケーション・ファンド(安定型)	13,654,762円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	14,980,843円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	10,475,502円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	7,137,094,577円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	5,263,802円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	51,759,489円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	38,646,421円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	134,204,157円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	75,760,513円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	59,288,519円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	79,095,393円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	735,756円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド	202,203,903円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	73,572,988円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	313,985,162円
三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド	22,192,438円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	37,778,851円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	30,874,063円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%)<適格機関投資家限定>	74,020,828円
合計	8,375,587,967円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	14,653.00	241,188.38	
		AGREE REALTY CORP	9,577.00	715,976.52	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	8,514.00	159,126.66	
		ALEXANDER'S INC	300.00	69,825.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	19,728.00	3,133,595.52	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	2,165.00	39,511.25	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	7,000.00	196,350.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	38,504.00	1,426,573.20	
		AMERICOLD REALTY TRUST INC	36,548.00	1,102,653.16	
		APARTMENT INCOME REIT CO	21,469.00	922,308.24	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	15,893.00	145,103.09	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	26,200.00	423,392.00	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	8,429.00	110,419.90	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	2,515.00	25,099.70	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	18,354.00	3,936,198.84	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,745.00	100,178.75	
		BOSTON PROPERTIES INC	18,428.00	1,581,122.40	

BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	8,400.00	44,352.00	
BRANDYWINE REALTY TRUST	20,191.00	169,402.49	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	39,200.00	885,136.00	
BROADSTONE NET LEASE INC	23,684.00	462,311.68	
BRT APARTMENTS CORP	500.00	11,585.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	13,982.00	1,885,332.88	
CARETRUST REIT INC	13,303.00	280,826.33	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	3,648.00	109,002.24	
CENTERSPACE	1,542.00	120,538.14	
CHATHAM LODGING TRUST	5,557.00	70,129.34	
CITY OFFICE REIT INC	4,603.00	53,348.77	
CLIPPER REALTY INC	800.00	6,792.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3,216.00	119,796.00	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	14,223.00	377,336.19	
COUSINS PROPERTIES INC	19,300.00	548,506.00	
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY T	2,658.00	18,473.10	
CTO REALTY GROWTH INC	4,049.00	82,356.66	
CUBESMART	29,248.00	1,374,363.52	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	26,676.00	244,618.92	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	69,000.00	52,785.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	37,661.00	4,686,911.45	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	23,884.00	33,437.60	
DOUGLAS EMMETT INC	23,532.00	500,290.32	
DUKE REALTY CORP	50,677.00	3,102,952.71	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	20,000.00	2,740.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	11,869.00	216,965.32	
EASTGROUP PROPERTIES INC	5,350.00	913,833.50	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	21,276.00	157,442.40	
EPR PROPERTIES	9,600.00	420,096.00	
EQUINIX INC	11,951.00	7,862,443.39	
EQUITY COMMONWEALTH	14,758.00	394,776.50	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	22,846.00	1,659,533.44	
EQUITY RESIDENTIAL	44,916.00	3,468,413.52	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	17,620.00	396,273.80	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	8,570.00	2,384,688.20	
EXTRA SPACE STORAGE INC	17,528.00	3,538,026.80	
FARMLAND PARTNERS INC	4,666.00	68,310.24	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	9,300.00	966,642.00	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	17,000.00	901,510.00	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	9,736.00	259,269.68	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	15,115.00	46,403.05	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	31,074.00	1,553,078.52	
GETTY REALTY CORP	5,036.00	152,238.28	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5,368.00	102,475.12	

GLADSTONE LAND CORP	4,464.00	104,279.04	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	5,669.00	61,905.48	
GLOBAL NET LEASE INC	13,146.00	178,391.22	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	48,800.00	1,200,968.00	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	71,699.00	1,961,684.64	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	2,876.00	29,939.16	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	13,846.00	433,795.18	
HOST HOTELS & RESORTS INC	95,339.00	1,738,983.36	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	17,289.00	244,639.35	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	28,050.00	566,329.50	
INDUS REALTY TRUST INC	823.00	49,659.82	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	6,274.00	44,545.40	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,822.00	362,325.60	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	8,406.00	226,793.88	
INVITATION HOMES INC	81,066.00	3,206,160.30	
IRON MOUNTAIN INC	37,588.00	2,075,985.24	
JBG SMITH PROPERTIES	15,318.00	341,744.58	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	130,900.00	87,048.50	
KILROY REALTY CORP	14,505.00	732,937.65	
KIMCO REALTY CORP	80,018.00	1,761,196.18	
KITE REALTY GROUP TRUST	28,356.00	562,866.60	
LIFE STORAGE INC	10,858.00	1,395,361.58	
LTC PROPERTIES INC	5,036.00	223,094.80	
LXP INDUSTRIAL TRUST	37,000.00	386,280.00	
MACERICH CO/THE	30,200.00	297,772.00	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	245,900.00	124,179.50	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	77,231.00	1,146,880.35	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	15,117.00	2,610,705.90	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	22,700.00	1,026,494.00	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	11,732.00	603,728.72	
NATL HEALTH INVESTORS INC	6,051.00	400,213.14	
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	17,023.00	122,395.37	
NETSTREIT CORP	4,793.00	94,805.54	
NEXPOINT RESIDENTIAL	3,529.00	190,954.19	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	5,071.00	91,379.42	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	30,977.00	1,012,328.36	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,352.00	56,706.72	
ORION OFFICE REIT INC	5,199.00	54,849.45	
PARAMOUNT GROUP INC	20,155.00	144,511.35	
PARK HOTELS & RESORTS INC	32,432.00	474,155.84	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	17,544.00	320,528.88	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	360.00	1,512.00	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	15,254.00	514,822.50	
PHYSICIANS REALTY TRUST	31,204.00	534,836.56	

PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	14,040.00	174,376.80	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,774.00	95,909.66	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	1,424.00	21,844.16	
PRIME US REIT	130,700.00	81,034.00	
PROLOGIS INC	97,452.00	12,632,702.76	
PUBLIC STORAGE	20,149.00	6,833,734.84	
REALTY INCOME CORP	79,480.00	5,308,469.20	
REGENCY CENTERS CORP	20,620.00	1,284,213.60	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	16,432.00	282,794.72	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	21,881.00	1,419,858.09	
RLJ LODGING TRUST	20,173.00	251,759.04	
RPT REALTY	8,262.00	80,224.02	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	7,126.00	616,113.96	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	32,679.00	487,243.89	
SAFEHOLD INC	1,242.00	49,344.66	
SAUL CENTERS INC	2,331.00	101,165.40	
SERVICE PROPERTIES TRUST	25,446.00	177,613.08	
SIMON PROPERTY GROUP INC	43,445.00	4,508,287.65	
SITE CENTERS CORP	26,013.00	349,354.59	
SL GREEN REALTY CORP	8,071.00	389,748.59	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	17,135.00	712,987.35	
STAG INDUSTRIAL INC	22,400.00	714,560.00	
STORE CAPITAL CORP	32,202.00	892,961.46	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	14,098.00	114,475.76	
SUN COMMUNITIES INC	16,193.00	2,570,314.89	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	29,379.00	331,688.91	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	15,336.00	241,542.00	
TERRENO REALTY CORP	9,726.00	617,990.04	
UDR INC	38,676.00	1,855,674.48	
UMH PROPERTIES INC	6,284.00	116,379.68	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,344.00	68,369.28	
URBAN EDGE PROPERTIES	15,028.00	246,459.20	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	2,927.00	48,734.55	
VENTAS INC	52,399.00	2,598,990.40	
VERIS RESIDENTIAL INC	10,798.00	151,279.98	
VICI PROPERTIES INC	127,470.00	4,298,288.40	
VORNADO REALTY TRUST	21,846.00	605,134.20	
WASHINGTON REIT	10,790.00	220,116.00	
WELLTOWER INC	60,047.00	4,659,046.73	
WHITESTONE REIT	4,511.00	45,786.65	
WP CAREY INC	25,176.00	2,170,422.96	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	15,327.00	254,274.93	
アメリカ・ドル小計	3,481,939.00	141,516,312.12 (20,211,359,697)	

カナダ・ ドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	8,800.00	280,984.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	9,662.00	105,895.52	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	2,725.00	37,250.75	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,190.00	156,852.30	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	13,622.00	49,992.74	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	11,424.00	525,618.24	
	CHOICE PROPERTIES REIT	17,893.00	248,175.91	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	5,107.00	79,873.48	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	4,551.00	75,637.62	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	17,899.00	216,935.88	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2,169.00	39,475.80	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	11,377.00	38,681.80	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	14,775.00	231,672.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4,448.00	332,310.08	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	16,425.00	206,955.00	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	1,387.00	6,116.67	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11,198.00	139,975.00	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	8,107.00	141,548.22	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,447.00	22,139.10	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1,557.00	25,892.91	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	4,345.00	43,363.10	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	12,305.00	155,658.25	
	PLAZA RETAIL REIT	8,509.00	35,822.89	
	PRIMARIS REIT	6,318.00	87,757.02	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	19,525.00	399,481.50	
	SLATE GROCERY REIT-CL U	3,196.00	45,798.68	
SLATE OFFICE REIT	3,663.00	16,630.02		
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	9,440.00	266,963.20		
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	13,800.00	257,646.00		
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4,770.00	29,144.70		
カナダ・ドル小計		253,634.00	4,300,248.38 (471,823,252)	
オースト ラリア・ ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	50,980.00	136,626.40	
	ARENA REIT	45,981.00	188,981.91	
	BWP TRUST	66,965.00	267,860.00	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	104,758.00	195,373.67	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	84,443.00	258,395.58	
	CENTURIA OFFICE REIT	43,559.00	70,565.58	
	CHARTER HALL GROUP	64,246.00	831,343.24	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	73,852.00	331,595.48	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	62,449.00	256,665.39	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	37,955.00	134,360.70	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	158,718.00	126,974.40	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	30,237.00	81,639.90	

	DEXUS/AU	137,000.00	1,159,020.00	
	GDI PROPERTY GROUP	43,204.00	39,963.70	
	GOODMAN GROUP	221,089.00	4,211,745.45	
	GPT GROUP	251,434.00	1,061,051.48	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	30,439.00	107,145.28	
	HEALTHCO REIT	51,410.00	88,682.25	
	HOME CONSORTIUM LTD	33,678.00	160,644.06	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	187,797.00	239,441.17	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	25,921.00	84,502.46	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	39,965.00	169,051.95	
	MIRVAC GROUP	534,373.00	1,132,870.76	
	NATIONAL STORAGE REIT	129,680.00	320,309.60	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	89,106.00	73,957.98	
	RURAL FUNDS GROUP	52,739.00	134,484.45	
	SCENTRE GROUP	698,931.00	2,012,921.28	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	143,852.00	388,400.40	
	STOCKLAND	314,996.00	1,127,685.68	
	VICINITY CENTRES	479,141.00	946,303.47	
	WAYPOINT REIT	113,111.00	289,564.16	
	オーストラリア・ドル小計	4,402,009.00	16,628,127.83 (1,625,399,495)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	239,000.00	807,820.00	
	FORTUNE REIT	208,000.00	1,318,720.00	
	LINK REIT	279,400.00	17,406,620.00	
	PROSPERITY REIT	178,000.00	395,160.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	110,000.00	404,800.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	230,000.00	561,200.00	
	香港・ドル小計	1,244,400.00	20,894,320.00 (380,067,681)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT	38,300.00	52,471.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	436,000.00	1,260,040.00	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	260,055.00	286,060.50	
	CAPITALAND CHINA TRUST	113,900.00	124,151.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	660,808.00	1,387,696.80	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	94,950.00	120,586.50	
	EC WORLD REIT	52,800.00	29,040.00	
	ESR-LOGOS REIT	606,713.00	245,718.76	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	190,000.00	120,650.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	176,400.00	49,392.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	141,800.00	324,722.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC I	370,238.00	510,928.44	
	IREIT GLOBAL	57,600.00	31,968.00	
	KEPPEL DC REIT	170,900.00	326,419.00	
KEPPEL REIT	275,800.00	303,380.00		

	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	262,000.00	213,530.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	273,200.00	715,784.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	432,950.00	761,992.00	
	MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	304,700.00	585,024.00	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	243,200.00	91,200.00	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	48,000.00	228,960.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	66,700.00	50,358.50	
	SPH REIT	115,700.00	108,179.50	
	STARHILL GLOBAL REIT	138,200.00	80,847.00	
	SUNTEC REIT	265,900.00	422,781.00	
	シンガポール・ドル小計	5,796,814.00	8,431,880.00 (860,894,948)	
ニュー ジーラン ド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	107,000.00	143,380.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	135,705.00	293,122.80	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	200,506.00	202,511.06	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	192,441.00	257,870.94	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	57,519.00	158,752.44	
	ニュージーランド・ドル小計	693,171.00	1,055,637.24 (92,114,906)	
イギリ ス・ボン ド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	53,280.00	37,189.44	
	AEW UK REIT PLC	9,000.00	9,342.00	
	ASSURA PLC	378,833.00	242,453.12	
	BALANCED COMM PROPERTY TRUST	89,651.00	84,540.89	
	BIG YELLOW GROUP PLC	23,140.00	289,018.60	
	BRITISH LAND CO PLC	118,763.00	491,797.58	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	125,000.00	147,375.00	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	108,964.00	79,761.64	
	CUSTODIAN REIT PLC	39,999.00	40,078.99	
	DERWENT LONDON PLC	15,701.00	381,534.30	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	95,000.00	91,485.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	30,485.00	155,930.77	
	HAMMERSON PLC	440,241.00	94,211.57	
	HOME REIT PLC	96,051.00	109,882.34	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	41,816.00	49,175.61	
	INTU PROPERTIES PLC	28,500.00	285.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	99,000.00	628,650.00	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	141,905.00	296,297.64	
	LXI REIT PLC	247,814.00	374,199.14	
	NEWRIVER REIT PLC	46,021.00	36,540.67	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	57,141.00	47,369.88	
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	182,000.00	250,614.00		
PRS REIT PLC/THE	89,207.00	90,099.07		
REGIONAL REIT LTD	45,664.00	30,594.88		
SAFESTORE HOLDINGS PLC	25,924.00	266,498.72		

	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	70,698.00	33,793.64	
	SEGRO PLC	157,959.00	1,469,966.45	
	SHAFTESBURY PLC	36,339.00	146,300.81	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	187,422.00	230,529.06	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	34,770.00	29,624.04	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	236,658.00	393,798.91	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	117,847.00	78,368.25	
	UNITE GROUP PLC/THE	52,000.00	546,520.00	
	WORKSPACE GROUP PLC	20,210.00	104,788.85	
	イギリス・ポンド小計	3,543,003.00	7,358,615.86 (1,220,573,613)	
イスラエル・シュケル	REIT 1 LTD	26,169.00	554,521.11	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	25,500.00	259,845.00	
	イスラエル・シュケル小計	51,669.00	814,366.11 (34,113,308)	
韓国・ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	6,350.00	28,606,750.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	24,000.00	130,800,000.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	4,067.00	19,541,935.00	
	JR REIT XXVII	19,000.00	90,155,000.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	6,226.00	32,126,160.00	
	LOTTE REIT CO LTD	12,522.00	62,547,390.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	9,815.00	43,333,225.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	8,762.00	69,833,140.00	
	SK REITS CO LTD	12,831.00	70,570,500.00	
	韓国・ウォン小計	103,573.00	547,514,100.00 (56,722,461)	
ユーロ	AEDIFICA	5,146.00	481,922.90	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	1,760.00	14,009.60	
	ALTAREA	723.00	96,882.00	
	BEFIMMO	519.00	24,600.60	
	CARE PROPERTY INVEST	3,490.00	75,035.00	
	CARMILA	7,172.00	99,690.80	
	COFINIMMO	4,000.00	401,200.00	
	COVIVIO	6,175.00	338,081.25	
	CROMWELL REIT EUR	48,320.00	95,190.40	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	5,801.00	120,660.80	
	GECINA SA	7,026.00	647,094.60	
	HAMBORNER REIT AG	11,000.00	88,990.00	
	ICADE	3,844.00	172,826.24	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	4,798.00	16,025.32	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	34,858.00	202,873.56	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	3,500.00	84,700.00	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	52,815.00	63,589.26	
	KLEPIERRE	25,069.00	511,908.98	

	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	6,940.00	32,271.00	
	MERCIALYS	6,257.00	49,680.58	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	42,596.00	392,096.18	
	MONTEA NV	1,234.00	107,234.60	
	NSI NV	2,336.00	68,678.40	
	RETAIL ESTATES	1,586.00	97,380.40	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	15,400.00	799,568.00	
	VASTNED RETAIL NV	2,035.00	43,142.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	18,467.00	546,253.86	
	WERELDHAVE NV	5,522.00	72,669.52	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	2,441.00	94,100.55	
	ユーロ小計	330,830.00	5,838,356.40 (839,730,801)	
投資証券合計			25,792,800,161 (25,792,800,161)	
合計			25,792,800,161 (25,792,800,161)	

(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 147銘柄	77.7%	78.4%
カナダ・ドル	投資証券 30銘柄	1.8%	1.8%
オーストラリア・ドル	投資証券 31銘柄	6.2%	6.3%
香港・ドル	投資証券 6銘柄	1.5%	1.5%
シンガポール・ドル	投資証券 25銘柄	3.3%	3.3%
ニュージーランド・ドル	投資証券 5銘柄	0.4%	0.4%
イギリス・ポンド	投資証券 34銘柄	4.7%	4.7%
イスラエル・シケル	投資証券 2銘柄	0.1%	0.1%
韓国・ウォン	投資証券 9銘柄	0.2%	0.2%
ユーロ	投資証券 29銘柄	3.2%	3.3%

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。

【中間財務諸表】

1. 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3、第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期中間計算期間(2022年9月13日から2023年3月12日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

【三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第5期 (2022年 9月12日現在)	第6期中間計算期間 (2023年 3月12日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	691,882	653,769
コール・ローン	19,446,501	20,742,634
親投資信託受益証券	1,618,812,630	1,794,545,207
未収入金	395,000	-
流動資産合計	1,639,346,013	1,815,941,610
資産合計		
	1,639,346,013	1,815,941,610
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,192,741	1,385,212
未払受託者報酬	158,101	184,532
未払委託者報酬	1,502,342	1,753,473
未払利息	-	48
その他未払費用	47,438	55,394
流動負債合計	4,900,622	3,378,659
負債合計		
	4,900,622	3,378,659
純資産の部		
元本等		
元本	1,214,217,954	1,411,955,413
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	420,227,437	400,607,538
(分配準備積立金)	202,112,152	193,858,799
元本等合計	1,634,445,391	1,812,562,951
純資産合計		
	1,634,445,391	1,812,562,951
負債純資産合計		
	1,639,346,013	1,815,941,610

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第5期中間計算期間 自 2021年 9月11日 至 2022年 3月10日	第6期中間計算期間 自 2022年 9月13日 至 2023年 3月12日
営業収益		
受取利息	92	77
有価証券売買等損益	37,922,045	74,992,426
営業収益合計	37,921,953	74,992,349
営業費用		
支払利息	3,036	4,747
受託者報酬	124,852	184,532
委託者報酬	1,186,472	1,753,473
その他費用	37,750	55,652
営業費用合計	1,352,110	1,998,404
営業利益又は営業損失()	39,274,063	76,990,753
経常利益又は経常損失()	39,274,063	76,990,753
中間純利益又は中間純損失()	39,274,063	76,990,753
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	521,872	2,925,253
期首剰余金又は期首欠損金()	226,170,241	420,227,437
剰余金増加額又は欠損金減少額	66,001,813	73,151,554
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	66,001,813	73,151,554
剰余金減少額又は欠損金増加額	9,568,389	18,705,953
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	9,568,389	18,705,953
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	242,807,730	400,607,538

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第6期中間計算期間 自 2022年9月13日 至 2023年3月12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 当中間計算期間は前期末が休日のため、2022年9月13日から2023年3月12日までとなっております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第5期 (2022年9月12日現在)	第6期中間計算期間 (2023年3月12日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	1,214,217,954口	1,411,955,413口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.3461円 (1万口当たりの純資産額13,461円)	1口当たり純資産額 1.2837円 (1万口当たりの純資産額12,837円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第6期中間計算期間 (2023年3月12日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

項目	第5期 (2022年9月12日現在)	第6期中間計算期間 (2023年3月12日現在)
期首元本額	788,236,116円	1,214,217,954円
期中追加設定元本額	503,710,231円	252,591,718円
期中一部解約元本額	77,728,393円	54,854,259円

(参考)

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンドは、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「エマージング株式インデックス・マザーファンド」、「Jリート・インデックス・マザーファンド」および「外国リート・インデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内債券パッシブ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

	(2022年9月12日現在)	(2023年3月12日現在)
(単位：円)		
資産の部		
流動資産		
金銭信託	15,404,179	9,693,714
コール・ローン	432,960,001	424,585,251
国債証券	104,003,852,680	94,724,528,290
地方債証券	10,290,112,600	9,358,693,500
特殊債券	9,372,625,977	8,999,510,047
社債券	6,035,333,600	6,554,441,000
未収入金	59,880,900	-
未収利息	361,877,661	342,791,522
前払費用	16,416,621	11,981,319
流動資産合計	130,588,464,219	120,426,224,643
資産合計	130,588,464,219	120,426,224,643
負債の部		
流動負債		
未払解約金	72,957,000	7,466,830
未払利息	-	984
その他未払費用	2,171	1,964
流動負債合計	72,959,171	7,469,778

負債合計	72,959,171	7,469,778
純資産の部		
元本等		
元本	105,070,373,916	98,422,885,457
剰余金		
剰余金又は欠損金()	25,445,131,132	21,995,869,408
元本等合計	130,515,505,048	120,418,754,865
純資産合計	130,515,505,048	120,418,754,865
負債純資産合計	130,588,464,219	120,426,224,643

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年9月13日 至 2023年3月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年9月12日現在)	(2023年3月12日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	105,070,373,916口	98,422,885,457口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2422円 (1万口当たりの純資産額12,422円)	1口当たり純資産額 1.2235円 (1万口当たりの純資産額12,235円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年3月12日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>

(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(2022年9月12日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	106,912,762,885円
同期中における追加設定元本額	24,077,751,218円
同期中における一部解約元本額	25,920,140,187円
2022年9月12日現在の元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	7,405,294,843円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	12,270,168,802円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,846,992,295円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	823,848,056円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	41,070,800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)	188,185,362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)	504,029,049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)	879,417,622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)	450,102,528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)	581,272,184円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	140,807,106円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,924,964,674円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,056,053,003円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	422,825,277円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	57,571,397円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,949,732,234円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	654,426,007円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	970,730,653円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	217,690,587円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	35,698,724円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	192,969,140円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	283,890,678円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	506,037,343円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	144,781,815円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	8,007,380円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,217,386,473円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	11,436,365,442円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	6,128,242,930円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	15,401,942,052円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	306,310,460円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	526,289,799円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	257,205,778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>	119,981,072円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,802,337,039円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,124,463,694円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,254,065,737円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	8,157,611,864円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	961,967円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,109,862,458円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	415,038,581円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	499,895,584円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	170,458,356円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	43,709,085円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,352,499,366円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,036,009,210円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	649,577,213円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	210,001,663円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	20,814,251円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	265,467,132円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	4,985,334,340円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	1,213,665,167円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	1,185,737,715円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	1,518,563,091円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	5,104,008,838円
合計	105,070,373,916円

(2023年3月12日現在)

開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	105,070,373,916円
同期中における追加設定元本額	10,156,023,388円
同期中における一部解約元本額	16,803,511,847円

2023年3月12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)	8,059,060,040円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	12,929,720,578円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,070,418,190円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	730,535,067円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	41,854,235円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	200,118,070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)	552,449,258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)	955,279,633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)	506,039,972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)	638,606,515円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	140,216,448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DS・DCターゲットイヤーファンド2050	69,399,965円

三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	2,194,836,813円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	748,365,990円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	1,143,981,151円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	259,379,179円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	43,469,971円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	223,359,780円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	319,228,609円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	626,452,038円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	186,962,155円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	8,974,314円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	363,085円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	298,337円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	201,623円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	109,828円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	109,828円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,162,297,813円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	10,026,548,513円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	5,858,337,168円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	14,831,160,710円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	299,804,746円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	474,854,090円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	248,499,049円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	120,221,118円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,728,657,415円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,036,392,293円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,141,556,909円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	7,669,396,318円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	961,967円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,067,781,928円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	385,918,055円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	476,420,978円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	165,177,003円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	44,327,528円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,258,676,673円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	1,957,126,760円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	607,683,002円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	203,979,338円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	20,783,621円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	254,841,092円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	4,723,846,231円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	1,242,330,620円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	1,138,627,175円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	1,455,336,960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>	1,836,096,978円
合計	98,422,885,457円

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2022年9月12日現在)	(2023年3月12日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	40,066,476	20,353,225
金銭信託	4,633,429	4,706,821
コール・ローン	130,230,195	206,159,025
国債証券	26,458,313,532	20,548,939,446
派生商品評価勘定	-	60,266,625
未収入金	347,174	-
未収利息	122,417,680	126,702,668
前払費用	32,362,060	13,740,286
流動資産合計	26,788,370,546	20,980,868,096
資産合計	26,788,370,546	20,980,868,096
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	677,805,939	2,055,853
未払金	4,017,074	147,324,100
未払解約金	78,399,999	-
未払利息	-	478
その他未払費用	963	754
流動負債合計	760,223,975	149,381,185
負債合計	760,223,975	149,381,185
純資産の部		
元本等		
元本	20,045,986,946	16,820,902,425
剰余金		
剰余金又は欠損金 ()	5,982,159,625	4,010,584,486
元本等合計	26,028,146,571	20,831,486,911
純資産合計	26,028,146,571	20,831,486,911
負債純資産合計	26,788,370,546	20,980,868,096

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2022年9月13日 至 2023年3月12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</p> <p>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</p> <p>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券</p> <p>直近の最終相場等によって時価評価することが適切ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年9月12日現在)	(2023年3月12日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	20,045,986,946口	16,820,902,425口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2984円 (1万口当たりの純資産額12,984円)	1口当たり純資産額 1.2384円 (1万口当たりの純資産額12,384円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年3月12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)</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引)</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2022年9月12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		
	為替予約取引 売建 アメリカ・ドル	13,537,941,900	-	13,863,496,764	325,554,864

市場取引以 外の取引	カナダ・ドル	549,654,508	-	568,885,200	19,230,692
	オーストラリア・ドル	406,652,232	-	418,476,630	11,824,398
	シンガポール・ドル	255,385,269	-	261,701,301	6,316,032
	イギリス・ポンド	1,207,560,495	-	1,239,904,337	32,343,842
	イスラエル・シケル	102,531,296	-	102,966,990	435,694
	デンマーク・クローネ	96,995,512	-	99,744,348	2,748,836
	ノルウェー・クローネ	53,836,115	-	55,665,060	1,828,945
	スウェーデン・クローナ	66,863,394	-	69,104,691	2,241,297
	メキシコ・ペソ	213,210,399	-	222,269,748	9,059,349
	オフショア・人民元	750,597,731	-	766,242,378	15,644,647
	ポーランド・ズロチ	113,156,055	-	117,516,542	4,360,487
	ユーロ	8,771,610,386	-	9,017,827,242	246,216,856
	小計	26,125,995,292	-	26,803,801,231	677,805,939
	合 計	26,125,995,292	-	26,803,801,231	677,805,939

(2023年3月12日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち 1年超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	76,812,001	-	76,177,075	634,926
	カナダ・ドル	2,407,761	-	2,384,944	22,817
	オーストラリア・ドル	6,126,191	-	6,063,449	62,742
	ニュージーランド・ドル	842,747	-	827,013	15,734
	イギリス・ポンド	5,618,350	-	5,615,944	2,406
	デンマーク・クローネ	387,116	-	386,362	754
	メキシコ・ペソ	817,942	-	796,566	21,376
	オフショア・人民元	4,002,383	-	3,974,875	27,508
	ポーランド・ズロチ	1,353,343	-	1,346,339	7,004
	ユーロ	83,426,036	-	83,185,527	240,509
	小計	181,793,870	-	180,758,094	1,035,776
	売建				
	アメリカ・ドル	10,320,085,459	-	10,313,563,860	6,521,599
	カナダ・ドル	424,302,989	-	417,557,211	6,745,778
	オーストラリア・ドル	333,109,772	-	325,200,086	7,909,686

シンガポール・ドル	206,610,379	-	205,491,385	1,118,994
ニュージーランド・ドル	44,516,126	-	43,831,689	684,437
イギリス・ポンド	975,444,540	-	960,846,074	14,598,466
イスラエル・シケル	66,865,096	-	67,643,100	778,004
デンマーク・クローネ	66,989,281	-	66,840,626	148,655
ノルウェー・クローネ	42,920,453	-	41,648,355	1,272,098
スウェーデン・クローナ	42,842,176	-	41,672,785	1,169,391
メキシコ・ペソ	181,712,226	-	181,627,728	84,498
オフショア・人民元	986,045,316	-	981,487,368	4,557,948
ポーランド・ズロチ	93,885,096	-	94,119,985	234,889
ユーロ	6,899,309,876	-	6,883,861,985	15,447,891
小計	20,684,638,785	-	20,625,392,237	59,246,548
合計	20,866,432,655	-	20,806,150,331	58,210,772

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(2022年9月12日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	17,348,369,874円
同期中における追加設定元本額	10,681,951,147円
同期中における一部解約元本額	7,984,334,075円
2022年9月12日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	3,259,160,926円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	2,004,157,726円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	812,805,747円
イオン・バランス戦略ファンド	1,038,428,645円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	2,458,848,150円

三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)	922,475,104円
三井住友・資産最適化ファンド(3 バランス型)	1,688,186,609円
三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)	414,613,223円
三井住友・資産最適化ファンド(5 成長重視型)	135,457,382円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	58,264,769円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)	509,015,574円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,154,681,049円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	885,316円
SMAM・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	4,427,439,289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>	354,629,080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>	354,304,415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>	452,633,942円
合計	20,045,986,946円

(2023年3月12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	20,045,986,946円
同期中における追加設定元本額	2,514,010,522円
同期中における一部解約元本額	5,739,095,043円
2023年3月12日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,907,105,875円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	642,983,521円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	13,846,374円
イオン・バランス戦略ファンド	667,970,053円
三井住友・資産最適化ファンド(1 安定重視型)	2,851,209,350円
三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)	1,092,216,453円
三井住友・資産最適化ファンド(3 バランス型)	2,079,614,543円
三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)	512,425,383円
三井住友・資産最適化ファンド(5 成長重視型)	170,644,845円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	70,551,897円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)	565,234,893円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,116,669,391円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	885,316円
SMAM・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	3,673,662,431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>	466,596,380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>	433,948,468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>	555,337,252円
合計	16,820,902,425円

外国債券パッシブ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

(2022年9月12日現在)

(2023年3月12日現在)

資産の部		
流動資産		
預金	216,174,427	152,990,451
金銭信託	51,618,064	11,174,147
コール・ローン	1,450,811,286	489,428,259
国債証券	156,284,273,534	150,509,432,083
派生商品評価勘定	135,775	-
未収利息	895,513,359	967,301,515
前払費用	52,019,452	90,785,416
流動資産合計	158,950,545,897	152,221,111,871
資産合計	158,950,545,897	152,221,111,871
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	551,738	-
未払金	804,434,374	-
未払解約金	235,539,148	39,783,813
未払利息	-	1,134
その他未払費用	2,737	3,391
流動負債合計	1,040,527,997	39,788,338
負債合計	1,040,527,997	39,788,338
純資産の部		
元本等		
元本	76,795,410,154	78,529,125,247
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	81,114,607,746	73,652,198,286
元本等合計	157,910,017,900	152,181,323,533
純資産合計	157,910,017,900	152,181,323,533
負債純資産合計	158,950,545,897	152,221,111,871

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年9月13日 至 2023年3月12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>

	(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年9月12日現在)	(2023年3月12日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	76,795,410,154口	78,529,125,247口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.0562円 (1万口当たりの純資産額20,562円)	1口当たり純資産額 1.9379円 (1万口当たりの純資産額19,379円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年3月12日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2022年9月12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		
	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	419,826,935	-	419,385,707	441,228
	カナダ・ドル	19,096,753	-	19,096,996	243
	シンガポール・ドル	9,090,504	-	9,085,355	5,149
	イギリス・ポンド	40,962,831	-	41,031,426	68,595
	デンマーク・クローネ	3,622,456	-	3,620,897	1,559

市場取引以外	オフショア・人民元	43,012,952	-	43,078,842	65,890
の取引	ユーロ	277,328,813	-	277,225,882	102,931
	小計	812,941,244	-	812,525,105	416,139
	売建				
	デンマーク・クローネ	2,356	-	2,356	-
	ユーロ	1,229,058	-	1,228,882	176
	小計	1,231,414	-	1,231,238	176
	合計	814,172,658	-	813,756,343	415,963

(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。

(2023年3月12日現在)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(2022年9月12日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	81,240,238,352円
同期中における追加設定元本額	11,527,343,152円
同期中における一部解約元本額	15,972,171,350円
2022年9月12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	25,304,562,579円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	828,158,382円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,156,635,138円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,175,001,572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)	152,526,311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)	6,250,590円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	28,036,019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)	92,655,686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)	248,930,241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)	175,779,350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)	284,649,148円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	23,205,142円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	48,841,238円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	71,389,406円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	49,801,190円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	21,503,378円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	77,033,842円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	57,841,285円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	150,738,817円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	45,415,312円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	22,253,366円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	158,279,290円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	573,738,813円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	31,891,251円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	90,183,578円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	58,720,361円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,996,394円
日興F W S・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	392,532,958円
三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド	16,444,846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>	3,751,614,393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>	33,601,811円
S M A M・バランスファンドV A 2 5<適格機関投資家専用>	6,132,655,891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>	4,104,311,686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>	9,462,762,482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>	30,929,407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>	79,724,138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>	658,062,897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>	111,106,124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>	965,401,491円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0<適格機関投資家専用>	1,298,450,320円
S M A M・バランスファンドV A 4 0<適格機関投資家専用>	1,386,224,062円
S M A M・バランスファンドV A 3 5<適格機関投資家専用>	4,291,532,671円
S M A M・バランスV A株40T<適格機関投資家限定>	604,716円
S M A M・外国債券パッシブファンドV A<適格機関投資家限定>	7,287,566,777円
三井住友・外国債券インデックスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	314,944,759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>	128,907,845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>	70,531,533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>	31,256,873円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A<適格機関投資家専用>	11,647,293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>	84,871,500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>	380,180,554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>	90,192,358円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A 2<適格機関投資家専用>	38,868,189円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A 2<適格機関投資家専用>	5,501,058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>	925,852,704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>	568,480,944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>	801,852,282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>	471,632,336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>	292,927,346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>	127,771,330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>	98,401,799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>	126,093,242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>	284,951,860円
合 計	76,795,410,154円

(2023年3月12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	76,795,410,154円
同期中における追加設定元本額	7,035,830,084円
同期中における一部解約元本額	5,302,114,991円
2023年3月12日現在の元本の内訳	
三井住友・D C 外国債券インデックスファンドS	26,197,114,106円
三井住友・D C 年金バランス3 0 (債券重点型)	920,605,812円
三井住友・D C 年金バランス5 0 (標準型)	2,309,569,115円
三井住友・D C 年金バランス7 0 (株式重点型)	1,288,856,906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)	164,688,001円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 2 0 (4資産タイプ)	6,338,663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)	30,005,779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)	104,058,978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)	273,427,860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)	198,862,879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)	315,911,452円
三井住友・D C 年金バランスゼロ(債券型)	23,533,014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)	152,445,824円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	95,721,347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	29,841,628円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	88,271,146円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	67,071,279円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	179,229,608円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	53,838,460円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	27,132,651円
三井住友・D C つみたてN I S A ・世界分散ファンド	187,528,853円
三井住友D S ・外国債券インデックス年金ファンド	759,623,778円
三井住友D S ・年金バランス3 0 (債券重点型)	36,694,308円
三井住友D S ・年金バランス5 0 (標準型)	111,796,513円
三井住友D S ・年金バランス7 0 (株式重点型)	78,424,624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	3,855,167円
日興F W S ・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	917,390,648円
三井住友D S ・先進国債インデックス・ファンド	105,557,895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	27,622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	32,834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	40,651円

三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	47,947円
三井住友DS・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>	4,256,856,781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>	5,518,731,923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>	637,940,236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>	110,927,414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>	4,104,174,292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>	7,072,543,934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)	344,567,758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>	87,070,123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>	5,511,845円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	890,605,298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>	389,506,805円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	266,204,180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>	83,861,394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>	69,615,592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>	89,341,857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>	914,773,879円
合計	78,529,125,247円

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9月12日現在)	(2023年3月12日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	89,834,626	37,327,371

コール・ローン	2,524,951,156	1,634,940,968
株式	214,676,540,430	230,708,282,750
派生商品評価勘定	67,567,100	-
未収入金	-	22,800
未収配当金	107,003,079	414,748,824
差入委託証拠金	112,590,000	68,040,000
流動資産合計	217,578,486,391	232,863,362,713
資産合計	217,578,486,391	232,863,362,713
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	13,345,800
前受金	53,125,000	21,840,000
未払金	-	711,000
未払解約金	116,384,998	436,226,903
未払利息	-	3,792
その他未払費用	11,209	8,084
流動負債合計	169,521,207	472,135,579
負債合計	169,521,207	472,135,579
純資産の部		
元本等		
元本	64,681,311,514	66,519,584,282
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	152,727,653,670	165,871,642,852
元本等合計	217,408,965,184	232,391,227,134
純資産合計	217,408,965,184	232,391,227,134
負債純資産合計	217,578,486,391	232,863,362,713

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年9月13日 至 2023年3月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年9月12日現在)	(2023年3月12日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	64,681,311,514口	66,519,584,282口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.3612円 (1万口当たりの純資産額33,612円)	1口当たり純資産額 3.4936円 (1万口当たりの純資産額34,936円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年3月12日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(株式) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2022年9月12日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物 0412月	2,654,052,900	-	2,721,620,000	67,567,100
	小計	2,654,052,900	-	2,721,620,000	67,567,100
合計		2,654,052,900	-	2,721,620,000	67,567,100

(2023年3月12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 0506月	1,577,245,800	-	1,563,900,000	13,345,800
	小計	1,577,245,800	-	1,563,900,000	13,345,800
合計		1,577,245,800	-	1,563,900,000	13,345,800

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

- 2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(2022年9月12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	60,456,249,906円
同期中における追加設定元本額	12,113,029,153円
同期中における一部解約元本額	7,887,967,545円
2022年9月12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	9,532,155,480円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	1,024,578,616円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,612,955,175円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,551,056,908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)	122,904,750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)	4,296,896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)	19,400,437円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	62,615,670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)	164,050,569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)	145,160,441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)	260,258,888円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,387,774,054円
三井住友・DCつみたてN I S A・日本株インデックスファンド	21,027,174,341円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	131,058,857円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	212,157,060円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	139,804,903円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	38,125,053円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	191,441,180円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	177,791,284円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	646,292,493円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	357,670,813円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	410,137,910円

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	48,149,518円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	752,883,758円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	39,292,044円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	191,390,450円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	181,956,760円
三井住友DS・DCターゲットイヤーフンド2060	5,290,169円
日興FWS・日本株インデックス	1,165,067,037円
三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド	14,503,710円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,659,870,089円
バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	12,478,245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 >	81,298,159円
SMAM・バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 >	1,595,955,250円
SMAM・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	1,545,408,479円
SMAM・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	5,856,077,396円
SMAM・バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 >	38,205,939円
SMAM・バランスファンドVL50 < 適格機関投資家限定 >	147,542,596円
SMAM・バランスファンドVA75 < 適格機関投資家専用 >	694,789,862円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	46,213,392円
SMAM・インデックス・バランスVA25 < 適格機関投資家専用 >	254,234,553円
SMAM・インデックス・バランスVA50 < 適格機関投資家専用 >	801,202,128円
SMAM・バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 >	559,229,424円
SMAM・バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 >	1,751,291,234円
SMAM・バランスVA株40T < 適格機関投資家限定 >	372,784円
SMAM・グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	38,293,008円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 >	44,291,667円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A < 適格機関投資家専用 >	32,479,210円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A < 適格機関投資家専用 >	16,874,370円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L < 適格機関投資家専用 >	104,754,643円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 >	232,670,128円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2 < 適格機関投資家専用 >	54,509,181円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2 < 適格機関投資家専用 >	40,288,518円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2 < 適格機関投資家専用 >	7,737,301円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2 < 適格機関投資家専用 >	42,362,287円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2 < 適格機関投資家専用 >	564,856,832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)	178,230,052円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA < 適格機関投資家限定 >	211,396,741円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA < 適格機関投資家限定 >	95,343,921円
SMAM・世界バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 >	113,317,327円
SMAM・世界バランスファンドVA2 < 適格機関投資家限定 >	47,780,927円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	45,022,020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 >	33,345,709円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	42,282,418円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	55,774,152円
SMDAM・日米3資産バランスオープン < 適格機関投資家限定 >	18,136,348円
合計	64,681,311,514円

(2023年3月12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	64,681,311,514円
同期中における追加設定元本額	5,682,598,980円
同期中における一部解約元本額	3,844,326,212円

2023年3月12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	9,545,668,036円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	1,039,151,268円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	4,612,846,977円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	3,623,858,126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）	148,533,266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）	4,065,731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）	19,440,050円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）	64,738,989円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）	168,607,670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）	154,640,923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）	272,495,648円
国内株式指数ファンド（T O P I X ）	1,301,288,236円
三井住友・DCつみたてN I S A ・日本株インデックスファンド	23,103,535,778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）	236,686,594円
イオン・バランス戦略ファンド	56,211,176円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2050	46,276,830円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	197,847,379円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	187,140,830円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	702,234,131円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	393,752,742円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	451,673,107円
三井住友・DCつみたてN I S A ・世界分散ファンド	53,002,494円
三井住友D S ・国内株式インデックス年金ファンド	880,588,245円
三井住友D S ・年金バランス30（債券重点型）	40,285,090円
三井住友D S ・年金バランス50（標準型）	220,385,100円
三井住友D S ・年金バランス70（株式重点型）	215,669,797円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2060	5,996,391円
日興F W S ・日本株インデックス	1,510,978,990円
三井住友D S ・ T O P I X インデックス・ファンド	24,191,078円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2035	48,704円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2040	55,576円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2045	66,034円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2055	75,894円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2065	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）	2,529,871,063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＞	14,136,432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＞	1,298,693,337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＞	1,383,954,610円

SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	5,288,189,044円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	35,485,948円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	129,345,747円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	632,234,488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>	43,533,209円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	227,367,598円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	733,752,353円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	510,008,664円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,548,628,503円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	352,709円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	34,600,904円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	39,166,060円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	30,431,766円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	16,165,009円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	90,085,562円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	217,333,061円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	48,463,668円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	35,298,082円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	7,431,986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>	500,642,771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)	164,454,904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>	82,473,235円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	40,348,643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>	41,505,716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>	33,840,500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>	43,917,512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>	362,577,705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	66,519,584,282円

外国株式インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2022年9月12日現在)	(2023年3月12日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	3,391,761,553	3,857,558,342
金銭信託	59,808,893	4,987,881
コール・ローン	1,681,028,129	218,469,484
株式	418,939,787,808	442,339,061,501
投資証券	11,249,570,387	10,602,523,197
派生商品評価勘定	60,354,105	18,237,307

未収入金	23,211,666	309,364
未収配当金	864,034,421	907,544,304
差入委託証拠金	2,760,184,509	2,132,438,696
流動資産合計	439,029,741,471	460,081,130,076
資産合計	439,029,741,471	460,081,130,076
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	128,889,077	216,618,029
未払解約金	162,621,000	248,781,670
未払利息	-	506
その他未払費用	3,444	3,825
流動負債合計	291,513,521	465,404,030
負債合計	291,513,521	465,404,030
純資産の部		
元本等		
元本	69,094,291,205	75,578,656,846
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	369,643,936,745	384,037,069,200
元本等合計	438,738,227,950	459,615,726,046
純資産合計	438,738,227,950	459,615,726,046
負債純資産合計	439,029,741,471	460,081,130,076

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2022年9月13日 至 2023年3月12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	(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。 (2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年9月12日現在)	(2023年3月12日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	69,094,291,205口	75,578,656,846口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 6.3498円 (1万口当たりの純資産額63,498円)	1口当たり純資産額 6.0813円 (1万口当たりの純資産額60,813円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年3月12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9月12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		
	株価指数先物取引 買建 S&P 500 EMINI FUT SEP22	6,690,495,733	-	6,651,129,185	39,366,548

市場取引	SPI 200 FUTURES SEP22	320,502,700	-	319,632,725	869,975
	FTSE 100 IDX FUT SEP22	379,115,789	-	378,834,640	281,149
	EURO STOXX 50 SEP22	1,195,871,658	-	1,176,182,770	19,688,888
	小計	8,585,985,880	-	8,525,779,320	60,206,560
	合 計	8,585,985,880	-	8,525,779,320	60,206,560

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	1,168,388,166	-	1,160,919,696	7,468,470
	カナダ・ドル	56,159,908	-	55,946,420	213,488
	オーストラリア・ド ル	26,361,720	-	26,388,720	27,000
	香港・ドル	14,277,130	-	14,186,740	90,390
	シンガポール・ドル	7,176,161	-	7,145,785	30,376
	イギリス・ポンド	71,379,692	-	71,314,681	65,011
	イスラエル・シユケ ル	3,768,601	-	3,769,828	1,227
	スイス・フラン	44,594,262	-	44,654,042	59,780
	デンマーク・クロ ネ	10,877,972	-	10,830,024	47,948
	ノルウェー・クロ ネ	3,458,721	-	3,467,570	8,849
	スウェーデン・ク ローナ	13,635,679	-	13,623,593	12,086
	ユーロ	119,899,363	-	119,373,306	526,057
	小計	1,539,977,375	-	1,531,620,405	8,356,970
	売建				
	カナダ・ドル	2,193,644	-	2,193,740	96
	オーストラリア・ド ル	5,160,451	-	5,180,379	19,928
	香港・ドル	4,589,255	-	4,547,150	42,105
	イギリス・ポンド	4,974,837	-	4,975,080	243
	スイス・フラン	1,488,489	-	1,488,450	39
	ノルウェー・クロ ネ	577,684	-	577,880	196
	ユーロ	2,883,412	-	2,876,534	6,878
	小計	21,867,772	-	21,839,213	28,559
	合 計	1,561,845,147	-	1,553,459,618	8,328,411

(2023年3月12日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	S&P 500 EMINI FUT MAR23	5,092,967,555	-	4,878,406,680	214,560,875
	SPI 200 FUTURES MAR23	246,276,191	-	245,924,550	351,641
	FTSE 100 IDX FUT MAR23	306,130,873	-	306,903,373	772,500
	EURO STOXX 50 MAR23	1,035,883,717	-	1,050,556,650	14,672,933
	小計	6,681,258,336	-	6,481,791,253	199,467,083
	合 計	6,681,258,336	-	6,481,791,253	199,467,083

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

- 2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	58,849,722	-	58,849,030	692
	小計	58,849,722	-	58,849,030	692
	売建				
	アメリカ・ドル	127,373,383	-	126,286,330	1,087,053
	小計	127,373,383	-	126,286,330	1,087,053
合 計		186,223,105	-	185,135,360	1,086,361

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(2022年9月12日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	59,015,956,817円
同期中における追加設定元本額	20,494,529,737円
同期中における一部解約元本額	10,416,195,349円
2022年9月12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	35,123,557,567円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	275,483,003円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,087,497,791円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	775,204,438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)	32,852,387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)	991,074円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	5,203,753円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	16,441,879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)	48,359,688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)	52,502,521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)	102,719,093円
外国株式指数ファンド	912,210,161円
三井住友・DCつみたてN I S A・全海外株インデックスファンド	16,360,503,530円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	87,908,136円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	97,508,641円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	63,989,360円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	18,659,575円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	129,836,552円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	115,457,713円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	417,317,703円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	223,443,393円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	259,357,529円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	51,775,463円
三井住友D S・外国株式インデックス年金ファンド	1,286,812,799円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	10,651,413円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	44,388,614円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	39,139,513円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,603,182円
S M B C・DCインデックスファンド(M S C Iコクサイ)	297,954,594円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	211,751,353円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	1,158,782,933円
三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド	42,491,244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)	476,572,355円
バランスファンドV A(安定運用型)<適格機関投資家限定>	3,247,568円

SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	21,720,183円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	572,483,865円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	732,038,670円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	3,177,896,398円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	10,511,330円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	52,946,745円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	427,084,701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>	38,301,233円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	93,355,655円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	440,464,244円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	302,091,664円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	713,165,783円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	200,225円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	198,878,953円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	62,426,977円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	7,719,760円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	6,951,628円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	3,930,927円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	18,307,293円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	53,269,072円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	113,544,613円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	50,332,592円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	322,507,095円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	82,837,181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>	1,673,632,092円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	14,551,834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>	11,351,913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>	14,541,240円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	44,070,821円
合計	69,094,291,205円

(2023年3月12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	69,094,291,205円
同期中における追加設定元本額	11,226,582,830円
同期中における一部解約元本額	4,742,217,189円

2023年3月12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	37,716,830,813円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	291,250,437円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,110,547,547円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	813,819,301円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	34,796,040円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	984,064円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	5,457,854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)	17,365,378円

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	51,449,129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)	57,988,135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)	109,496,632円
外国株式指数ファンド	970,578,901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	18,862,075,943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)	173,771,188円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	108,600,174円
イオン・バランス戦略ファンド	23,635,162円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	23,869,007円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	138,725,214円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	125,940,294円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	468,729,224円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	254,756,811円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	295,023,299円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	59,118,836円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	1,905,485,014円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	11,361,775円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	53,005,543円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	48,493,992円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	3,083,614円
SMB C・DCインデックスファンド(M S C I コクサイ)	537,999,804円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	323,464,820円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	1,760,236,234円
三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド	55,996,112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
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)	418,412,080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 >	4,079,135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 >	18,997,417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 >	483,887,764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 >	678,624,260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 >	2,968,447,459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 >	9,822,476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 >	47,808,223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 >	401,254,495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 >	35,766,460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 >	84,832,561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 >	411,687,872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 >	285,814,713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 >	651,616,409円
S M A M ・バランスV A 株 4 0 T < 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・V A S (適格機関投資家専用)	188,524,259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 >	58,376,901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 >	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>	16,578,047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>	248,532,488円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	71,006,432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>	1,416,226,598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>	16,756,227円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	14,013,949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>	17,872,703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>	256,600,029円
合 計	75,578,656,846円

エマージング株式インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2022年9月12日現在)	(2023年3月12日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	1,576,229,216	1,521,213,452
金銭信託	2,158,311	1,574,017
コール・ローン	60,662,910	68,942,048
株式	19,267,678,516	23,896,631,147
投資信託受益証券	1,211,446,537	1,445,976,308
投資証券	1,910,817,739	2,186,976,687
派生商品評価勘定	1,804,422	-
未収配当金	47,894,311	43,748,412
差入委託証拠金	394,092,069	654,507,487
流動資産合計	24,472,784,031	29,819,569,558
資産合計	24,472,784,031	29,819,569,558
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	42,882,179	134,121,423
未払解約金	4,239,510	1,578,129
未払利息	-	158
その他未払費用	597	533
流動負債合計	47,122,286	135,700,243
負債合計	47,122,286	135,700,243
純資産の部		
元本等		
元本	14,201,860,735	18,132,916,892
剰余金		

剰余金又は欠損金（ ）	10,223,801,010	11,550,952,423
元本等合計	24,425,661,745	29,683,869,315
純資産合計	24,425,661,745	29,683,869,315
負債純資産合計	24,472,784,031	29,819,569,558

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2022年9月13日 至 2023年3月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資信託受益証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項 目	(2022年9月12日現在)	(2023年3月12日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	14,201,860,735口	18,132,916,892口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.7199円 (1万口当たりの純資産額17,199円)	1口当たり純資産額 1.6370円 (1万口当たりの純資産額16,370円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年3月12日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(株式、投資信託受益証券、投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2022年9月12日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MSCI EMGMKT SEP22	2,116,071,821	-	2,075,161,032	40,910,789
	小計	2,116,071,821	-	2,075,161,032	40,910,789
合計		2,116,071,821	-	2,075,161,032	40,910,789

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	63,000,000	-	62,833,032	166,968
	小計	63,000,000	-	62,833,032	166,968
合計		63,000,000	-	62,833,032	166,968

(2023年3月12日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MSCI EMGMKT MAR23	2,262,527,710	-	2,128,586,422	133,941,288
	小計	2,262,527,710	-	2,128,586,422	133,941,288

合計	2,262,527,710	-	2,128,586,422	133,941,288
----	---------------	---	---------------	-------------

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	23,000,000	-	22,819,865	180,135
	小計	23,000,000	-	22,819,865	180,135
合計		23,000,000	-	22,819,865	180,135

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(2022年9月12日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	8,888,051,553円
同期中における追加設定元本額	7,116,611,786円
同期中における一部解約元本額	1,802,802,604円
2022年9月12日現在の元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	7,759,749,632円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	2,877,312,344円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	49,002,422円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	236,594,721円

アセットアロケーション・ファンド(成長型)	155,000,946円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	34,122,519円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	94,365,741円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	70,242,472円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	299,371,907円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	243,657,870円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	400,901,356円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	94,046,132円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	4,741,880円
日興F W S・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	494,788,425円
日興F W S・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	1,312,279,169円
三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド	11,175,759円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	64,507,440円
合計	14,201,860,735円

(2023年3月12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	14,201,860,735円
同期中における追加設定元本額	4,498,110,309円
同期中における一部解約元本額	567,054,152円
2023年3月12日現在の元本の内訳	
三井住友・DCつみたてN I S A・全海外株インデックスファンド	9,209,594,790円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	3,081,867,128円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	327,156,914円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	427,754,439円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	271,706,212円
イオン・バランス戦略ファンド	156,307,775円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	44,166,842円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	103,276,702円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	78,666,022円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	351,106,019円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	286,634,906円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	473,886,463円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	106,676,249円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	5,714,445円
日興F W S・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	899,583,832円
日興F W S・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	2,228,938,673円
三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド	18,998,970円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	39,354円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	47,702円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	59,031円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	69,168円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	69,168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>	60,596,088円
合計	18,132,916,892円

Jリート・インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2022年9月12日現在)	(2023年3月12日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,734,473	976,113
コール・ローン	48,750,235	42,753,806
投資証券	9,847,729,000	11,270,837,600
派生商品評価勘定	283,600	-
未収入金	-	358,785
未収配当金	114,103,009	151,463,640
前払金	-	108,000
差入委託証拠金	2,350,000	2,200,000
流動資産合計	10,014,950,317	11,468,697,944
資産合計	10,014,950,317	11,468,697,944
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	192,400
前受金	208,000	-
未払解約金	729,780	1,067,097
未払利息	-	98
その他未払費用	479	292
流動負債合計	938,259	1,259,887
負債合計	938,259	1,259,887
純資産の部		
元本等		
元本	3,618,768,466	4,527,539,911
剰余金		
剰余金又は欠損金()	6,395,243,592	6,939,898,146
元本等合計	10,014,012,058	11,467,438,057
純資産合計	10,014,012,058	11,467,438,057
負債純資産合計	10,014,950,317	11,468,697,944

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年9月13日 至 2023年3月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	（2022年9月12日現在）	（2023年3月12日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	3,618,768,466口	4,527,539,911口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.7672円 （1万口当たりの純資産額27,672円）	1口当たり純資産額 2.5328円 （1万口当たりの純資産額25,328円）

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	（2023年3月12日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資証券）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

（2022年9月12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		
	リート指数先物取引				

市場取引	買建				
	TREIT 先物 0412月	40,146,400	-	40,430,000	283,600
	小計	40,146,400	-	40,430,000	283,600
	合 計	40,146,400	-	40,430,000	283,600

(2023年3月12日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引	リート指数先物取引				
	買建				
	TREIT 先物 0506月	36,382,400	-	36,190,000	192,400
	小計	36,382,400	-	36,190,000	192,400
	合 計	36,382,400	-	36,190,000	192,400

(注) 1. 時価の算定方法

リート指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2)リート指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(2022年9月12日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	2,675,035,456円
同期中における追加設定元本額	2,538,256,373円
同期中における一部解約元本額	1,594,523,363円
2022年9月12日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	69,933,114円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	138,890,778円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	107,176,523円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	2,119,488,327円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2050	16,140,629円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	57,002,092円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	42,983,263円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	148,291,027円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	83,664,634円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	65,470,159円
三井住友・DCつみたてN I S A ・世界分散ファンド	28,910,457円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2060	2,245,677円
三井住友D S ・国内リートインデックス年金ファンド	85,939,337円

日興FWS・Jリートインデックス	305,206,603円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	20,225,759円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	3,493,800円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	63,085,945円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	48,115,503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>	61,060,756円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%) <適格機関投資家限定>	151,444,083円
合計	3,618,768,466円

(2023年3月12日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	3,618,768,466円
同期中における追加設定元本額	1,421,934,551円
同期中における一部解約元本額	513,163,106円
2023年3月12日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	226,397,249円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	305,708,131円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	146,354,780円
イオン・バランス戦略ファンド	30,645,687円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	2,344,888,211円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	16,345,622円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	68,293,308円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	51,203,366円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	183,019,784円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	102,954,850円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	82,033,861円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	34,898,429円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,105,549円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	195,798,657円
日興FWS・Jリートインデックス	448,045,672円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	52,050,243円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	10,354円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	13,938円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	20,309円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	26,282円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	26,282円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	3,304,473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>	48,692,628円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	40,824,607円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	51,471,466円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%) <適格機関投資家限定>	92,406,173円
合計	4,527,539,911円

外国リート・インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2022年9月12日現在)	(2023年3月12日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	141,283,164	278,584,119
金銭信託	1,988,582	830,112
コール・ローン	55,892,399	36,358,957
投資証券	25,792,800,161	25,717,724,142
派生商品評価勘定	84,452	368,679
未収入金	1,725,836	2,217,998
未収配当金	46,375,941	74,252,366
流動資産合計	26,040,150,535	26,110,336,373
資産合計	26,040,150,535	26,110,336,373
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	343,991	344,278
未払金	7,135,212	-
未払解約金	20,688,744	320,000
未払利息	-	84
その他未払費用	335	363
流動負債合計	28,168,282	664,725
負債合計	28,168,282	664,725
純資産の部		
元本等		
元本	8,375,587,967	9,476,224,426
剰余金		
剰余金又は欠損金 ()	17,636,394,286	16,633,447,222
元本等合計	26,011,982,253	26,109,671,648
純資産合計	26,011,982,253	26,109,671,648
負債純資産合計	26,040,150,535	26,110,336,373

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2022年9月13日 至 2023年3月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年9月12日現在)	(2023年3月12日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	8,375,587,967口	9,476,224,426口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.1057円 (1万口当たりの純資産額31,057円)	1口当たり純資産額 2.7553円 (1万口当たりの純資産額27,553円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年3月12日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資証券）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2022年9月12日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

	契 約 額 等	
--	---------	--

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	50,900,000	-	50,566,235	333,765
	オーストラリア・ドル	2,000,000	-	2,007,723	7,723
	シンガポール・ドル	1,200,000	-	1,193,095	6,905
	イギリス・ポンド	2,100,000	-	2,096,944	3,056
	小計	56,200,000	-	55,863,997	336,003
	売建				
	アメリカ・ドル	11,500,000	-	11,423,536	76,464
	小計	11,500,000	-	11,423,536	76,464
合 計		67,700,000	-	67,287,533	259,539

(2023年3月12日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	41,900,000	-	41,588,960	311,040
	イギリス・ポンド	5,500,000	-	5,496,164	3,836
	ユーロ	5,700,000	-	5,670,598	29,402
	小計	53,100,000	-	52,755,722	344,278
	売建				
	カナダ・ドル	25,500,000	-	25,131,321	368,679
	小計	25,500,000	-	25,131,321	368,679
	合 計		78,600,000	-	77,887,043

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(2022年9月12日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	5,775,124,200円
同期中における追加設定元本額	3,433,415,780円
同期中における一部解約元本額	832,952,013円
2022年9月12日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	13,654,762円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	14,980,843円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	10,475,502円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	7,137,094,577円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	5,263,802円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	51,759,489円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	38,646,421円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	134,204,157円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	75,760,513円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	59,288,519円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	79,095,393円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	735,756円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド	202,203,903円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	73,572,988円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	313,985,162円
三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド	22,192,438円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	37,778,851円
SMAM・年金WRリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	30,874,063円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%) <適格機関投資家限定>	74,020,828円
合計	8,375,587,967円

(2023年3月12日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	8,375,587,967円
同期中における追加設定元本額	1,483,120,473円
同期中における一部解約元本額	382,484,014円
2023年3月12日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	23,413,696円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	31,557,028円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	66,797,802円
イオン・バランス戦略ファンド	78,808,279円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	7,661,329,538円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	6,782,666円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	61,984,484円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	46,265,977円

三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	163,877,247円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	91,944,781円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	73,248,141円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	95,394,016円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	881,315円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド	363,158,524円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	98,304,170円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	459,448,180円
三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド	24,087,055円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	7,339円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	7,706円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	9,541円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	11,376円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	11,376円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	35,722,574円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	31,468,138円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%) <適格機関投資家限定>	61,703,477円
合計	9,476,224,426円

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

2023年3月31日現在

資産総額	1,854,783,535円
負債総額	891,447円
純資産総額（ - ）	1,853,892,088円
発行済口数	1,441,081,326口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2865円
（1万口当たり純資産額）	（12,865円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

イ 名義書換

該当事項はありません。

ロ 受益者名簿

作成しません。

ハ 受益者に対する特典

ありません。

ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等

（イ）受益権の譲渡

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

（ロ）受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

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

ホ 受益権の再分割

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

へ 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。

ハ 会社の機構

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

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

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

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

ニ 投資信託の運用の流れ



2【事業の内容及び営業の概況】

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

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			
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			
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			
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			
小計	4,873,482	5,039,817	166,335
合計	14,172,545	13,712,543	460,001

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

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

（単位：千円）

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

（単位：千円）

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

当事業年度(自 2021年 4月 1日 至 2022年 3月31日)

(単位：千円)

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

(単位：千円)

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

4. 減損処理を行った有価証券

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

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

当事業年度において、減損処理を行った有価証券はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

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

(2)退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位：千円)

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

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

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

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

(4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表わしております。）

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

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

(収益認識関係)

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

(セグメント情報等)

前事業年度(自2020年4月1日至2021年3月31日)

1. セグメント情報

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

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

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 2021年4月1日 至2022年3月31日)

1. セグメント情報

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

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

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

(関連当事者情報)

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1)兄弟会社等

(単位：千円)

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

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

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1)兄弟会社等

(単位：千円)

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

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

(1株当たり情報)

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

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

当事業年度の潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2. 1株当たり当期純利益又は1株当たり当期純損失の算定上の基礎は、次のとおりであります。

	前事業年度 (自 2020年 4月 1日 至 2021年 3月 31日)	当事業年度 (自 2021年 4月 1日 至 2022年 3月 31日)
1株当たり当期純利益又は当期純損失		
当期純利益又は当期純損失()(千円)	28,934,237	4,119,040
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益又は 当期純損失()(千円)	28,934,237	4,119,040
期中平均株式数(株)	33,870,060	33,870,060

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

(単位：千円)

第38期中間会計期間 (2022年 9月 30日)	
資産の部	
流動資産	
現金及び預金	35,409,452
金銭の信託	9,386,865
顧客分別金信託	300,043
前払費用	601,040
未収委託者報酬	11,798,214
未収運用受託報酬	2,759,722
未収投資助言報酬	386,860
未収収益	40,783
その他	307,594
流動資産合計	60,990,577
固定資産	
有形固定資産	1 2,044,583
無形固定資産	
のれん	3,197,680
顧客関連資産	12,501,978
その他	2,865,181
無形固定資産合計	18,564,839
投資その他の資産	
投資有価証券	11,924,303
関係会社株式	11,850,598
その他	1,571,118
貸倒引当金	20,750
投資その他の資産合計	25,325,270
固定資産合計	45,934,694
資産合計	106,925,272
負債の部	
流動負債	
リース債務	2,564
顧客からの預り金	28,648
その他の預り金	93,717
未払金	5,378,614
未払費用	4,957,793
未払法人税等	910,281
前受収益	32,553
賞与引当金	1,973,312

その他	2	482,541
流動負債合計		13,860,025
固定負債		
リース債務		3,243
繰延税金負債		987,563
退職給付引当金		5,137,995
固定負債合計		6,128,802
負債合計		19,988,828
純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,628,984
その他資本剰余金		73,466,962
資本剰余金合計		82,095,946
利益剰余金		
利益準備金		284,245
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		2,489,135
利益剰余金合計		2,773,380
株主資本合計		86,869,326
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		67,117
評価・換算差額等合計		67,117
純資産合計		86,936,444
負債純資産合計		106,925,272

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		31,446,166
運用受託報酬		4,428,746
投資助言報酬		607,317
その他の営業収益		126,597
営業収益計		36,608,828
営業費用		25,074,910
一般管理費	1	9,497,685
営業利益		2,036,233
営業外収益	2	87,533
営業外費用	3	309,096
経常利益		1,814,670
特別損失	4	6,885
税引前中間純利益		1,807,784
法人税、住民税及び事業税		784,532
法人税等調整額		171,342
法人税等合計		613,189
中間純利益		1,194,594

(3)中間株主資本等変動計算書

第38期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金			利益剰余金	
		資本準備金	その他資本 剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金 繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	3,834,794
当中間期変動額						
剰余金の配当						2,540,254
中間純利益						1,194,594
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）						
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	1,345,660
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	2,489,135

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	4,119,040	88,214,986	297,138	297,138	88,512,124
当中間期変動額					
剰余金の配当	2,540,254	2,540,254			2,540,254
中間純利益	1,194,594	1,194,594			1,194,594
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）			230,020	230,020	230,020
当中間期変動額 合計	1,345,660	1,345,660	230,020	230,020	1,575,680
当中間期末残高	2,773,380	86,869,326	67,117	67,117	86,936,444

注記事項

(重要な会計方針)

1. 資産の評価基準及び評価方法

(1)有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法

その他有価証券

市場価格のない株式等以外

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

(2)金銭の信託

運用目的の金銭の信託

時価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産（リース資産を除く）

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

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物	8～50年
器具備品	4～15年

(2)無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

のれん	14年
顧客関連資産	6～19年
ソフトウェア（自社利用分）	5年（社内における利用可能期間）

(3)リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

3．引当金の計上基準

(1)貸倒引当金

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

(2)賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。

(3)退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4．収益及び費用の計上基準

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

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

(1)委託者報酬

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

(2)運用受託報酬

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

(3)投資助言報酬

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

（会計方針の変更）

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用しております。これによる当中間財務諸表に与える影響はありません。

（中間貸借対照表関係）

第38期中間会計期間 (2022年9月30日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	1,632,164千円
2.消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。
3.当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。	当座借越極度額の総額 10,000,000千円 借入実行残高 - 差引額 10,000,000千円
4.当社は、子会社であるSumitomo Mitsui DS Asset Management(USA) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、2023年6月までの賃借料総額40,711千円の支払保証を行っております。	

(中間損益計算書関係)

第38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
1.一般管理費のうち主要なもの	のれん償却費 152,270千円 減価償却実施額 有形固定資産 173,639千円 無形固定資産 1,441,546千円
2.営業外収益のうち主要なもの	為替差益 7,815千円 受取配当金 1,230千円 投資有価証券償還益 20,660千円 投資有価証券売却益 25,620千円
3.営業外費用のうち主要なもの	投資有価証券償還損 43,419千円 投資有価証券売却損 152,586千円 金銭の信託運用損 113,089千円
4.特別損失のうち主要なもの	固定資産除却損 6,885千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第38期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

1.発行済株式数に関する事項

	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数
普通株式	33,870,060株	-	-	33,870,060株

2.剰余金の配当に関する事項

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

(リース取引関係)

第38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
1.オペレーティング・リース取引 (借主側)	未経過リース料(解約不能のもの) 1年以内 1,161,545千円 1年超 1,742,317千円 合計 2,903,862千円

(金融商品関係)

1. 金融商品の時価等に関する事項

第38期中間会計期間（2022年9月30日）

2022年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のないものは、次表には含まれておりません（（注1）参照）。また、現金及び預金、顧客分別金信託、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収投資助言報酬、顧客からの預り金、未払金は、短期間で決済されるため時価が帳簿価格に近似することから、注記を省略しております。

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 金銭の信託	9,386,865	9,386,865	-
(2) 投資有価証券 その他有価証券	11,884,494	11,884,494	-
資産計	21,271,360	21,271,360	-

（注1）市場価格のない金融商品

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額
その他有価証券 非上場株式	39,809
合計	39,809
子会社株式 非上場株式	11,850,598
合計	11,850,598

これらについては、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号2020年3月31日）第5項に従い、1. 金融商品の時価等に関する事項及び2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中には含めておりません。

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

（単位：千円）

区分	時価			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
(1) 金銭の信託	-	9,386,865	-	9,386,865
(2) 投資有価証券 その他有価証券	-	11,884,494	-	11,884,494
資産計	-	21,271,360	-	21,271,360

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

(1) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、デリバティブ取引は、取引相手先金融機関より提示された価格によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2) 投資有価証券 その他有価証券

投資有価証券は、市場での取引頻度が低く、活発な市場における相場価格とは認められないため、公表されている基準価額又は取引金融機関から提示された価格により評価しております。

（有価証券関係）

第38期中間会計期間（2022年9月30日）

1. 子会社株式

子会社株式（中間貸借対照表計上額 11,850,598千円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

2. その他有価証券

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	4,799,952	4,484,899	315,053
小計	4,799,952	4,484,899	315,053
(2)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	7,084,541	7,290,117	205,575
小計	7,084,541	7,290,117	205,575
合計	11,884,494	11,775,016	109,477

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

(デリバティブ取引関係)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

(収益認識関係)

第38期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

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

(セグメント情報等)

第38期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

1.セグメント情報

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

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

2.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位:千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への営業収益	31,446,166	4,428,746	607,317	126,597	36,608,828

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

3.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
1株当たり純資産額	2,566円76銭
1株当たり中間純利益	35円26銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

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

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

〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

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

□ 販売会社

名称	資本金の額（百万円） 2022年3月末現在	事業の内容
PayPay銀行株式会社	37,250	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。
株式会社みなと銀行	39,984	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。
a uカブコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社S B I証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
岡三証券株式会社	5,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
Jトラストグローバル証券株式会社	3,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
静岡東海証券株式会社	600	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	17,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
フィリップ証券株式会社	950	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
S M B C日興証券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	12,200	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
播陽証券株式会社	112	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,945	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
岡三にいがた証券株式会社	852	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
住友生命保険相互会社	639,000	保険業法に基づき、生命保険業を営んでいます。

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

2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

□ 販売会社

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

3【資本関係】

（持株比率5%以上を記載しています。）

販売会社である住友生命保険相互会社は、委託会社株式を10.4%保有しています。

第3【その他】

- 1 目論見書の表紙から本文の前までおよび裏表紙の記載について
 - (1) 「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨を記載することがあります。
 - (2) 委託会社の金融商品取引業者登録番号を記載することがあります。
 - (3) 委託会社のホームページのアドレスおよび他のインターネットのアドレス（これらのアドレスをコード化した図形等も含む）を記載することがあります。
 - (4) 請求目論見書の入手方法および投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨を記載することがあります。
 - (5) 目論見書の使用開始日を記載することがあります。
 - (6) 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。
 - (7) 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨を記載することがあります。
 - (8) 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載をすることがあります。
 - (9) 当ファンドのロゴおよび委託会社のロゴを記載することがあります。
 - (10) ファンドの形態および属性、申込みにかかる事項、ユニバーサルデザインフォントマークを記載することがあります。
 - (11) 写真、イラスト、図案およびキャッチコピーを採用することがあります。また、ファンドの管理番号等を記載することがあります。
- 2 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。
- 3 当ファンドの投資信託約款の全文を請求目論見書に掲載することがあります。
- 4 目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」と称して使用することがあります。
- 5 評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。
- 6 有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドの実質的な投資対象資産に共通性がある場合には、当該複数のファンドを一つの投資信託説明書（交付目論見書）で説明することがあります。また、有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドにかかる投資信託説明書（交付目論見書）および投資信託説明書（請求目論見書）を一体のものとして使用することがあります。

独立監査人の監査報告書

2022年6月15日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 羽 太 典 明指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅 野 雅 子指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐 藤 栄 裕**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第37期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2022年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2022年11月29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・DCつみたてNISA・世界分散ファンドの2021年9月11日から2022年9月12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・DCつみたてNISA・世界分散ファンドの2022年9月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表

示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年11月18日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐藤 栄裕**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第38期事業年度の中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2022年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の中間監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。 2 . X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年5月30日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンドの2022年9月13日から2023年3月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンドの2023年3月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年9月13日から2023年3月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。 2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。