

## 【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12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・資産最適化ファンド（1安定重視型） 三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型） 三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型） 三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型） 三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型） 1兆円を上限とします。 三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型） 1兆円を上限とします。 三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型） 1兆円を上限とします。 三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型） 1兆円を上限とします。 三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型） 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・資産最適化ファンド（１安定重視型）

三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）

三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）

三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）

三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）

以下、上記５ファンドを総称して「当ファンド」ということがあり、それぞれを「各ファンド」ということがあります。

また、「三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）」を「１安定重視型」、「三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）」を「２やや安定型」、「三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）」を「３バランス型」、「三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）」を「４やや成長型」、「三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）」を「５成長重視型」という略称でいうことがあります。

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンド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、「１安定重視型」は「最適安定重視」、「２やや安定型」は「最適やや安定」、「３バランス型」は「最適バランス」、「４やや成長型」は「最適やや成長」、「５成長重視型」は「最適成長重視」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

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

(5) 【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

(7) 【申込期間】

2023年6月13日から2023年12月12日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。

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

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

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

## ( 1 2 ) 【その他】

## イ 申込証拠金

ありません。

## ロ 日本以外の地域における募集

ありません。

## ハ スイッチング

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

## ニ お申込不可日

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

・ニューヨークの取引所の休業日

・ニューヨークの銀行の休業日

## ホ クーリング・オフ制度(金融商品取引法第37条の6)の適用

ありません。

## ヘ 振替受益権について

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

## (参考：投資信託振替制度)

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

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

・ファンドの設定、解約等における決済リスクが削減されます。

・振替口座簿に記録されますので、受益権の所在が明確になります。

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

- イ 当ファンドは、主として、投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に投資することにより、信託財産の成長を目指して運用を行います。
- ロ 委託会社は、受託会社と合意の上、各ファンドにつき、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。

## (ロ) 当ファンドが該当する属性区分

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

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

#### 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式	年1回	グローバル		
一般		(日本を含む)		
大型株	年2回	日本		
中小型株	年4回	北米		
債券	年6回(隔月)	欧州	ファミリーファンド	あり (部分ヘッジ)
一般	年12回(毎月)	アジア		
公債	日々	オセアニア		
社債	その他	中南米		
その他債券	( )		ファンド・オブ・ファン ズ	なし
クレジット属性 ( )				
不動産投信		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) 資産配分変更型))		中近東(中東)		
資産複合 ( )		エマージング		
資産配分固定 型				
資産配分変更 型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

す。商品分類、属性区分の全体的な定義等は一般社団法人投資信託協会のホームページ (<https://www.toushin.or.jp/>) をご覧ください。

## (2) 【ファンドの沿革】

2017年9月14日 信託契約締結、設定、運用開始。

## (3) 【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(イ) 委託会社 「三井住友DSアセットマネジメント株式会社」

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

(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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

(ハ) 販売会社

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

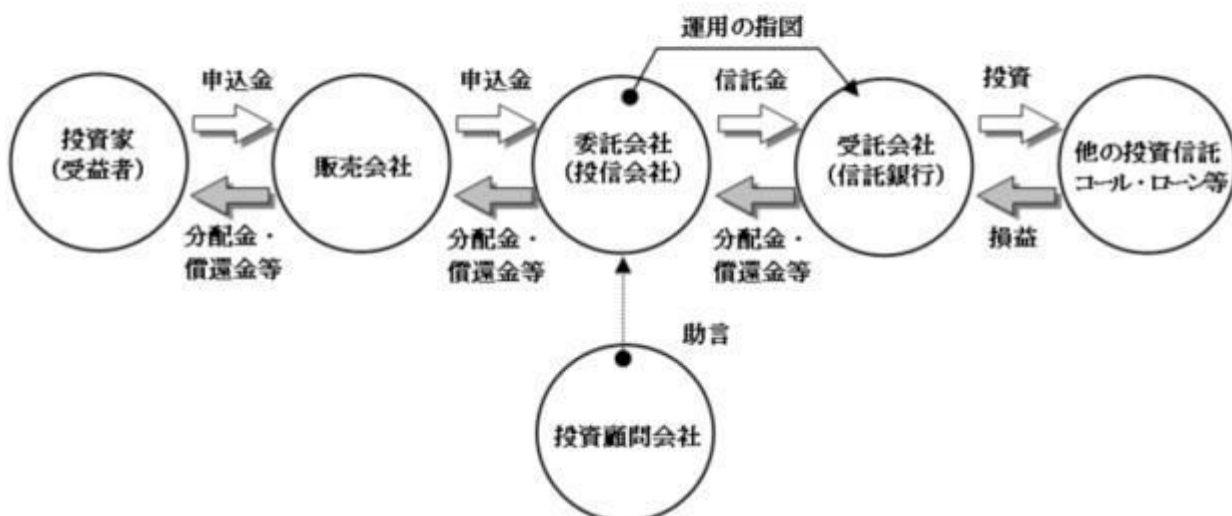
[参考情報：投資顧問会社]

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

イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社

各ファンドの基本資産配分に関する投資助言等を行います。

### 運営の仕組み



## □ 委託会社の概況

## (イ) 資本金の額

20億円（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

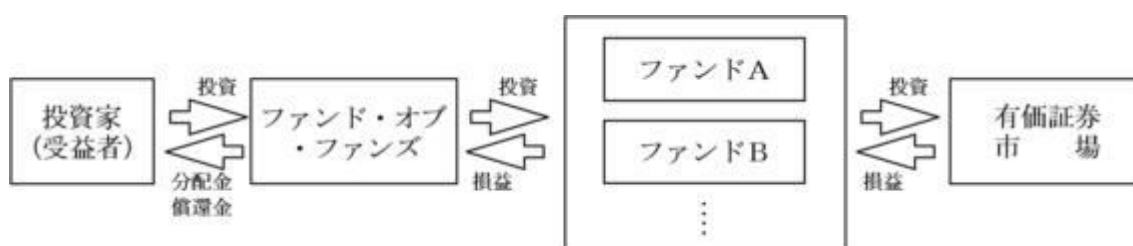
(2023年3月31日現在)

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

## 八 ファンドの運用形態（ファンド・オブ・ファンズによる運用）

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

## 〔ファンド・オブ・ファンズによる運用〕



## 2 【投資方針】



## (1) 【投資方針】

## イ 基本方針

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

## ロ 投資態度

(イ) 主として、投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託(リート)等に分散投資することにより、長期的な視点の基に各ファンド以下の運用を行います。

(1 安定重視型) 安定的な収益の確保と信託財産の安定的な成長を目指して運用を行います。

(2 やや安定型) 安定的な収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行います。

(3 バランス型) 信託財産の成長と安定的な収益の確保の両方をバランスよく目指す運用を行います。

(4 やや成長型) 信託財産の成長と安定的な収益の確保を目指して積極的な運用を行います。

(5 成長重視型) 信託財産の成長を目指して積極的な運用を行います。

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

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

(ロ) イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の助言に基づき、基本資産配分比率を決定します。

( ) 基本資産配分比率は、各資産の期待収益率やリスク(標準偏差)および資産間の相関係数等を推計・最適化して算出します。

(ハ) 実質組入外貨建資産については、投資信託証券内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。

(ニ) 投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

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

## ファンドの特色

### 1

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

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

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

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

イボットソン・アソシエイツ・ジャパンの助言に基づき、基本資産配分比率を決定します。

イボットソン・アソシエイツ・ジャパンは、各資産の期待収益率やリスク（標準偏差）および資産間の相関係数等を推計・最適化して基本資産配分比率を算出し、助言します。

### 3

目標リスク水準の異なる5つのファンドからお選びいただけます。



目標リスク水準とは

目標リスク水準は各ファンドのリスク（標準偏差）の目安を表示したものです。

一般にリスクの数値が大きいほどリターン（収益）の振れ幅が大きくなる傾向があります。

**1安定重視型** 安定的な収益の確保と信託財産の安定的な成長を目指して運用を行います。

**2やや安定型** 安定的な収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行います。

**3バランス型** 信託財産の成長と安定的な収益の確保の両方をバランスよく目指す運用を行います。

**4やや成長型** 信託財産の成長と安定的な収益の確保を目指して積極的な運用を行います。

**5成長重視型** 信託財産の成長を目指して積極的な運用を行います。

各ファンド間でスイッチングが可能です。ただし、販売会社によっては、スイッチングを行わない場合があります。また、一部のファンドのみの取扱いとなる場合があります。

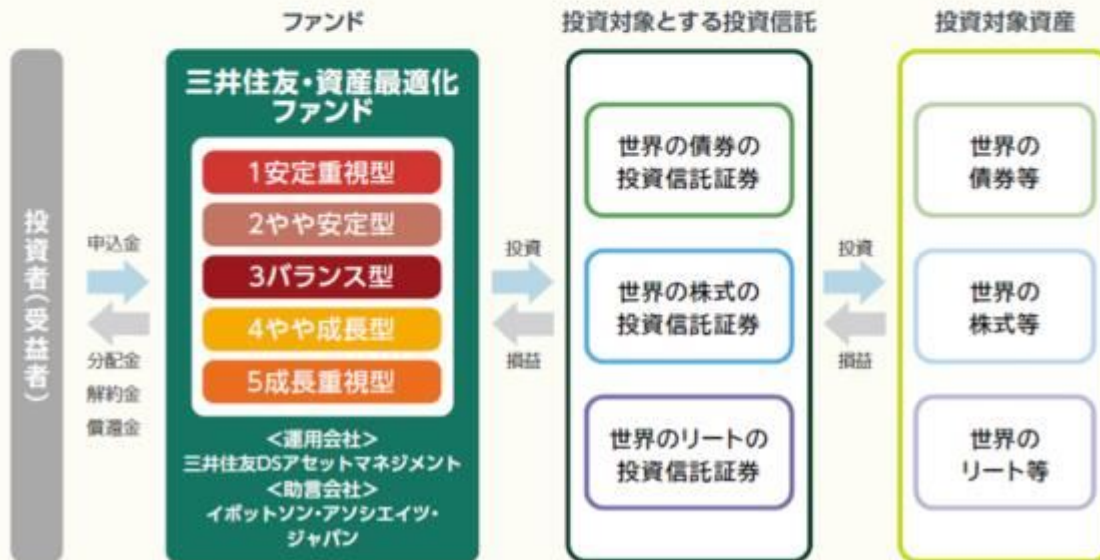
4

実質組入外貨建資産については、投資信託証券内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。

## ファンドのしくみ

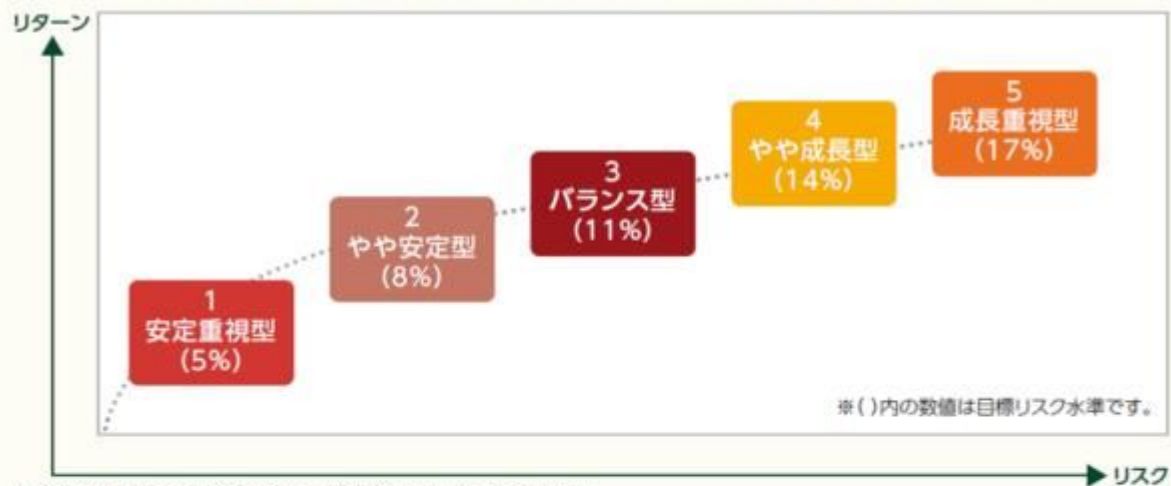
■ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



## ライフプランに合わせて5つのファンドから選択

■投資者の皆さまそれぞれのライフプランやリスク許容度に合わせて、目標リスク水準が異なる5つのファンドからお選びいただけます。

### 〔5つのファンドの目標リスク水準とリスク・リターン特性のイメージ〕



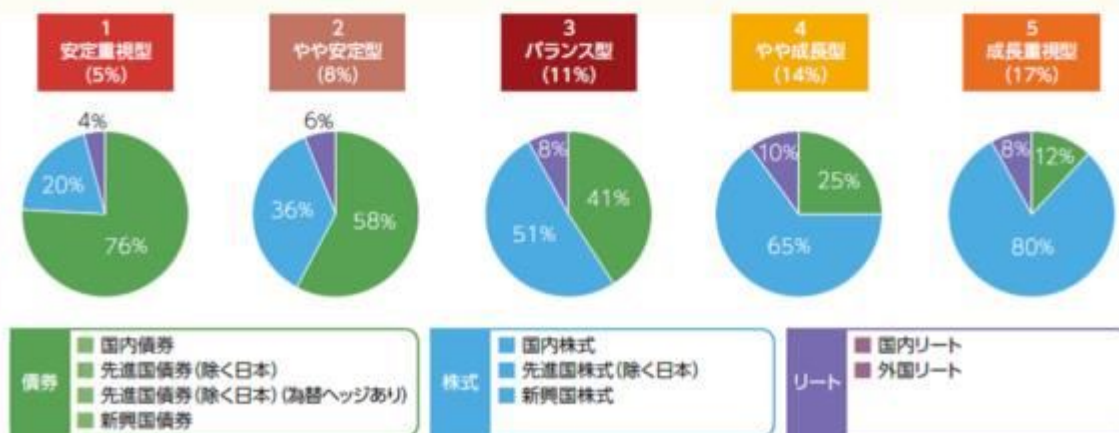
(出所)イボットソン・アソシエイツ・ジャパンの情報を基に委託会社作成

※上記はイメージであり、実際とは異なる場合があります。

※目標リスク水準は2023年3月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

## ポートフォリオの基本資産配分イメージ

■目標リスク水準に応じて、基本資産配分比率は各ファンドで異なります。



※( )内の数値は目標リスク水準です。

※円グラフ内の数値は基本資産配分比率です。

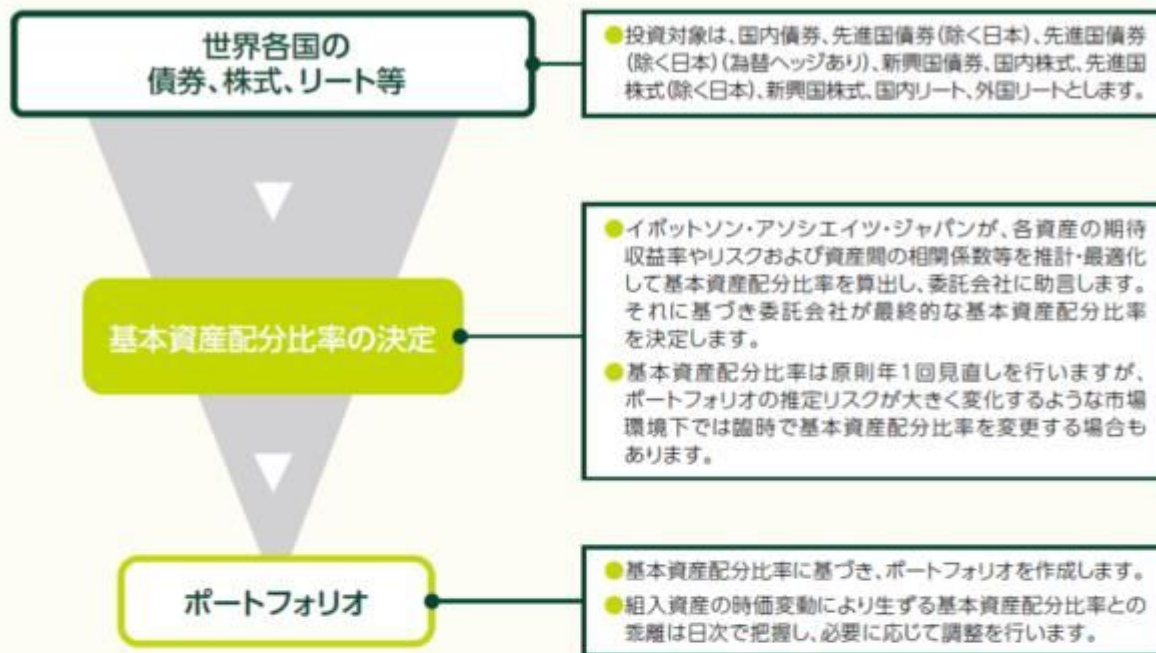
(出所)イボットソン・アソシエイツ・ジャパンの情報を基に委託会社作成

※基本資産配分比率は2023年3月末現在のものであり、今後変更される場合があります。



## 運用プロセス

■世界各国の債券、株式およびリート等を投資対象とし、イボットソン・アソシエイツ・ジャパンからの助言に基づき基本資産配分比率を決定し、ポートフォリオを構築します。



※上記の運用プロセスは2023年3月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

## イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社について



- イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社は、米国のモーニングスター・グループの日本法人です。
- 1977年にロジャー・G・イボットソン(現イェール大学経営大学院教授)が金融経済学の研究成果を投資実務に役立たせるという理念に基づき、米国Ibbotson Associates, Inc.(現Morningstar Investment Management LLC)を設立しました。
- イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社は、世界の資本市場の長期的なリスクとリターン調査研究に基づき、中立的な観点から投資判断に役立つ情報とポートフォリオ構築ツールを提供しています。

(出所)イボットソン・アソシエイツ・ジャパンの情報を基に委託会社作成

## (2) 【投資対象】

### イ 投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

1. 有価証券
2. 約束手形
3. 金銭債権

(ロ) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

## 1. 為替手形

## □ 投資対象とする有価証券

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

## 1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

## 八 投資対象とする金融商品

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

## 1. 預金

## 2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

## 3. コール・ローン

## 4. 手形割引市場において売買される手形

## 〔参考情報：投資対象とする投資信託の概要〕

●すべての投資信託に投資するとは限りません。

## ▶ 債券

## 国内債券

ファンド名	国内債券パッシブ・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	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"> <li>●NOMURA-BPI(総合)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。</li> <li>●日本の公社債および短期金融資産を主要投資対象とします。</li> </ul>
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.03%

## 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"> <li>●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に連動する投資成果を目指します。</li> <li>●ベンチマーク採用国の国債を主要投資対象とします。</li> <li>●保有する外貨建て資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。</li> </ul>
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.1%

## 為替ヘッジ付き先進国債券(除く日本)…為替ヘッジあり

ファンド名	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	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"> <li>●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に連動する投資成果を目指します。</li> <li>●ベンチマーク採用国の国債を主要投資対象とします。</li> <li>●保有する外貨建て資産については、対円での為替のフルヘッジを原則とします。</li> </ul>
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.1%

## 新興国債券…為替ヘッジなし\*1

ファンド名	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 ETF
形態	米国籍外国投資信託(米ドル建て)
運用会社	ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>●J.P.モルガンEMBIグローバル・コア・インデックスをベンチマークとし、インデックスの構成銘柄の債券を主要投資対象とします。</li> <li>●ベンチマークのパフォーマンスへの連動を目指します。</li> </ul>
管理費用*2	年0.39%
購入の可否*3	日本において一般投資者の購入が可能です。

\*1 新興国債券への基本資産配分比率は10%を上限とします。

\*2 管理費用とはETFの運用管理費用およびその他費用をETFの平均純資産総額で除したもので、本書の数値はETFの直近の目論見書等で開示されているものです。

\*3 外国籍のETFは、海外の上場有価証券を取り次ぐことのできる証券会社を通じて、日本国内の一般の投資者が、直接購入することができるものがあります。  
直接購入される際は、売買委託手数料(証券会社ごとに異なります。)がかかります。また、円貨と外貨を交換する際に、証券会社が別途定める手数料がかかります。



## ▶ 株式

## 国内株式

ファンド名	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)
形態	国内籍親投資信託
運用会社	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)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.08%

## 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"> <li>●主として世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指します。</li> <li>●外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。</li> </ul>
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%

## 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"> <li>●主として新興国の株式(預託証書(DR)、株式の値動きに連動する有価証券を含みます。)、新興国の株式指数を対象とした先物取引および新興国の株式等を主要投資対象とする上場投資信託証券に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。</li> <li>●外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。</li> </ul>
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%



## ▶ 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"> <li>● 東証REIT指数(配当込み)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。</li> <li>● 日本の取引所に上場(上場予定を含みます。)している不動産投資信託(REIT)を主要投資対象とします。</li> </ul>
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%

## 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"> <li>● S&amp;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。</li> <li>● 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ます。</li> <li>● 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。</li> </ul>
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%

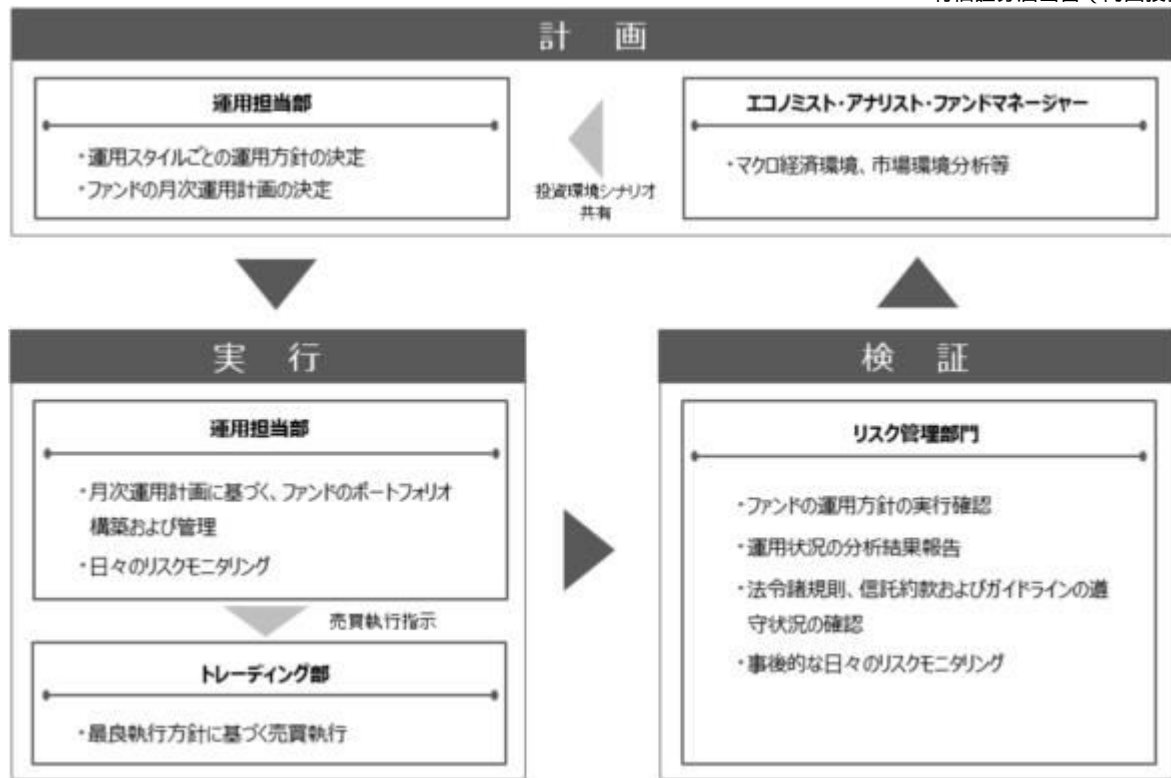

 指数の著作権など

- 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、J.P.モルガンEMBIグローバル・コア・インデックスはJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシー、TOPIX(東証株価指数)および東証REIT指数は株式会社JPX総研、MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスはMSCI Inc.、S&P先進国REIT指数はS&P 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。

※ 上記は、2023年3月末現在における投資対象とする投資信託であり、今後変更となる場合があります。

## (3) 【運用体制】

## イ ファンドの運用体制



リスク管理部門の人員数は、約50名です。

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

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

□ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

（４）【分配方針】

年１回（原則として毎年９月１５日。ただし、休業日の場合は翌営業日）決算を行い、原則として以下の方針に基づき分配金額を決定します。

- イ 分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。
- ロ 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投資制限

- イ 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- ロ 投資信託証券とコマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限ります。
- ハ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- ニ 投資信託証券を組み入れる場合において、一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、当該投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ホ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ヘ 公社債の借入れの指図
- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認められたときは、担保の提供の指図をするものとします。
- (ロ) 公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- (ニ) 借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。
- ト 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。
- チ 外国為替予約取引の指図
- 委託会社は、信託財産に属する外貨建資産（投資信託証券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。）について、当該外貨建資産の対円で為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。
- リ 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。

### 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。対円での為替ヘッジ比率は、資産配分の調整に伴い変動します。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) 投資信託に関する留意点

- ・当ファンドは一部、実質的に「ファミリーファンド方式」により運用します。そのため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・一部解約により資金の流出入が生じた場合、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ある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性、換金申込みの受け付けが中止となる可能性、既に受け付けた換金申込みが取り消しとなる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性等があります。

(ロ) 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。

#### ■ 1 安定重視型



### 〔 ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較 〕

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



#### ■ 2 やや安定型



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

### 【 ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移 】

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

#### ■ 3 バランス型



### 【 ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較 】

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



#### ■ 4 やや成長型



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。



## 【 ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移 】

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

### ■ 5成長重視型



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

## 【 ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較 】

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



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

## 各資産クラスの指数

日本株	TOPIX (東証株価指数、配当込み) 株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社が算出、公表する指数で、日本の株式を対象としています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス ( gross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 ( gross配当込み、円ベース ) MSCI Inc.が開発した指数で、新興国の株式を対象としています。
日本国債	NOMURA-BPI (国債) 野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する指数で、国内で発行された公募固定利付国債を対象としています。
先進国債	FTSE世界国債インデックス ( 除く日本、円ベース ) FTSE Fixed Income LLCにより運営されている指数で、日本を除く世界の主要国の国債を対象としています。
新興国債	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド (円ベース) J.P. Morganが算出、公表する指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。

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

## 4 【手数料等及び税金】

### ( 1 ) 【申込手数料】

ありません。

## (2) 【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

## (3) 【信託報酬等】

ファンド	純資産総額に年0.968%（税抜き0.88%）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0.39%	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0.46%	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
	受託会社	年0.03%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価
	上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。 委託会社の配分には、ファンドの運用に関して、助言を行う投資顧問会社に支払う投資顧問報酬が含まれています。		
投資対象とする投資信託	年0.39%程度（最大） <sup>*</sup> 管理報酬等は年度によって異なります。		
実質的な負担	ファンドの純資産総額に対して年1.007%（最大）（税抜き0.919%）程度 <sup>*</sup> 実質的な負担は、基本資産配分比率の見直しおよび実際の組入状況等により変動します。 ETFの基本資産配分比率を上限の10%と仮定して算出した試算値です。		

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

## (4) 【その他の手数料等】

- イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、原則として、計算期間を通じて毎日、純資産総額に年0.0066%（税抜き0.006%）以内の率を乗じて得た金額が信託財産の費用として計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となることがあります。2023年4月以降の決算等にかかる財務諸表の監査を行う監査法人を、PwCあらた有限責任監査法人に変更します。
- 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、外国における資産の保管等に要する費用、および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。

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

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

## （５）【課税上の取扱い】

### イ 個別元本について

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

### ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

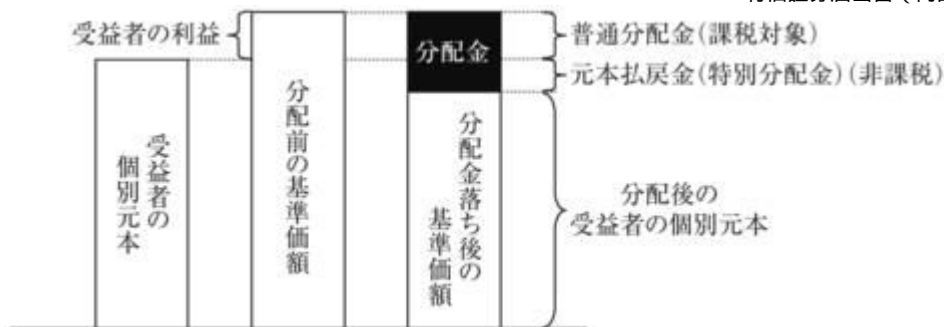
### ハ 収益分配金の課税について

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

収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金（課税対象）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。ただし、販売会社によっては当ファンドをNISA、ジュニアNISAでの取扱い対象としない場合があります。

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

	少額投資非課税制度 NISA	未成年者少額投資非課税制度 ジュニアNISA
対象となる投資信託	公募株式投資信託	
非課税対象	公募株式投資信託から生じる配当所得および譲渡所得	
利用対象となる方	18歳以上の日本居住者 (専用口座が開設される年の1月1日現在)	0～17歳の日本居住者 (専用口座が開設される年の1月1日現在)
非課税の期間	最長5年間(新規の購入は2023年まで)*	
利用できる限度額	120万円/年 (最大600万円)	80万円/年 (最大400万円)

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

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2023年3月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

## 5【運用状況】

### (1)【投資状況】

#### 三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）

2023年3月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	175,570,720	1.97
親投資信託受益証券	日本	8,654,082,804	96.94
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	97,505,097	1.09
合計（純資産総額）		8,927,158,621	100.00

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

#### 三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）

2023年3月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	127,880,322	2.85
親投資信託受益証券	日本	4,310,114,194	96.01
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	51,159,147	1.14
合計（純資産総額）		4,489,153,663	100.00

#### 三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）

2023年3月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	453,894,441	3.81
親投資信託受益証券	日本	11,341,478,767	95.10
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	129,937,446	1.09
合計（純資産総額）		11,925,310,654	100.00

## 三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）

2023年3月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	259,194,904	4.81
親投資信託受益証券	日本	5,070,567,247	94.15
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	56,103,425	1.04
合計（純資産総額）		5,385,865,576	100.00

## 三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）

2023年3月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	306,438,847	5.73
親投資信託受益証券	日本	4,980,800,722	93.21
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	56,297,644	1.06
合計（純資産総額）		5,343,537,213	100.00

## （2）【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## 三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）

## イ 主要投資銘柄

2023年3月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	2,836,070,978	1.2915	3,662,744,529	1.2619	3,578,837,967	40.09
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	2,186,741,613	1.2403	2,712,147,581	1.2401	2,711,778,274	30.38

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	148,637,628	6.1463	913,568,827	6.1473	913,720,090	10.24
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)	211,812,693	3.3128	701,696,708	3.4858	738,336,685	8.27
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	69,626,194	2.9011	201,995,856	2.6449	184,154,320	2.06
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	107,677,981	1.7011	183,167,387	1.6467	177,313,331	1.99
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	70,705,563	2.7043	191,208,532	2.4895	176,021,499	1.97
アメリカ	投資証券	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF	15,337	11,325.31	173,696,216	11,447.53	175,570,720	1.97
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	88,271,146	2.0396	180,034,926	1.9703	173,920,638	1.95

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

#### ロ 種類別投資比率

2023年3月31日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	1.97
親投資信託受益証券	96.94
合計	98.91

#### 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)

##### イ 主要投資銘柄

2023年3月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	1,077,884,858	1.2904	1,390,925,610	1.2619	1,360,182,902	30.30
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	744,332,199	1.2401	923,039,371	1.2401	923,046,359	20.56
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	133,397,032	6.1530	820,786,673	6.1473	820,031,574	18.27
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)	194,623,831	3.3093	644,078,071	3.4858	678,419,750	15.11

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	50,706,295	2.9109	147,601,577	2.6449	134,113,079	2.99
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	81,183,599	1.7003	138,039,403	1.6467	133,685,032	2.98
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	67,071,279	2.0390	136,761,396	1.9703	132,150,541	2.94
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	51,610,748	2.7086	139,791,333	2.4895	128,484,957	2.86
アメリカ	投資証券	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 E T F	11,171	11,335.30	126,626,647	11,447.53	127,880,322	2.85

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 (%)
投資証券	2.85
親投資信託受益証券	96.01
合計	98.86

## 三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）

### イ 主要投資銘柄

2023年3月31日現在

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額単価 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	490,463,483	6.1586	3,020,579,739	6.1473	3,015,026,169	25.28
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	1,996,546,621	1.2901	2,575,788,737	1.2619	2,519,442,181	21.13
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）	721,741,015	3.3106	2,389,402,987	3.4858	2,515,844,830	21.10
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	1,137,510,515	1.2401	1,410,590,555	1.2401	1,410,626,789	11.83
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	357,410,974	1.6975	606,709,934	1.6467	588,548,650	4.94
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	182,701,161	2.9002	529,876,128	2.6449	483,226,300	4.05



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	183,019,784	2.7067	495,376,730	2.4895	455,627,752	3.82
アメリカ	投資証券	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF	39,650	11,311.34	448,494,509	11,447.53	453,894,441	3.81
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	179,229,608	2.0378	365,240,683	1.9703	353,136,096	2.96

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(%)
投資証券	3.81
親投資信託受益証券	95.10
合計	98.91

#### 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)

##### イ 主要投資銘柄

2023年3月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	263,419,266	6.1598	1,622,597,929	6.1473	1,619,317,253	30.07
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)	400,988,865	3.3125	1,328,272,975	3.4858	1,397,766,985	25.95
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	488,700,892	1.2892	630,023,438	1.2619	616,691,655	11.45
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	296,080,167	1.6927	501,160,573	1.6467	487,555,210	9.05
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	256,950,619	1.2394	318,470,549	1.2401	318,644,462	5.92
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	101,405,598	2.9052	294,599,733	2.6449	268,207,666	4.98
アメリカ	投資証券	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF	22,642	11,321.86	256,349,487	11,447.53	259,194,904	4.81

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	102,954,850	2.7097	278,974,563	2.4895	256,306,099	4.76
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	53,838,460	2.0370	109,669,512	1.9703	106,077,917	1.97

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## ロ 種類別投資比率

2023年3月31日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	4.81
親投資信託受益証券	94.15
合計	98.96

## 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)

### イ 主要投資銘柄

2023年3月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	304,300,190	6.1609	1,874,768,832	6.1473	1,870,624,557	35.01
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	453,231,329	3.3124	1,501,293,620	3.4858	1,579,873,766	29.57
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	488,413,482	1.6927	826,728,630	1.6467	804,270,480	15.05
アメリカ	投資証券	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF	26,769	11,325.77	303,179,667	11,447.53	306,438,847	5.73
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	164,331,195	1.2898	211,950,248	1.2619	207,369,534	3.88
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	78,291,246	2.9149	228,214,568	2.6449	207,072,516	3.88
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	82,033,861	2.7052	221,914,423	2.4895	204,223,296	3.82
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	43,469,971	1.2389	53,855,664	1.2401	53,907,111	1.01
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	27,132,651	2.0327	55,152,780	1.9703	53,459,462	1.00

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（％）
投資証券	5.73
親投資信託受益証券	93.21
合 計	98.95

【投資不動産物件】

三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）

該当事項はありません。

三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）

該当事項はありません。

## 三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）

該当事項はありません。

## 三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）

該当事項はありません。

## （3）【運用実績】

## 【純資産の推移】

## 三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2018年 9月18日)	188,363,034	188,363,034	9,891	9,891
第2期 (2019年 9月17日)	1,356,985,451	1,356,985,451	10,327	10,327
第3期 (2020年 9月15日)	3,201,120,313	3,201,120,313	10,352	10,352
第4期 (2021年 9月15日)	6,014,936,981	6,014,936,981	10,987	10,987
第5期 (2022年 9月15日)	7,936,728,790	7,936,728,790	10,277	10,277
2022年 3月末日	7,308,344,308	-	10,689	-
4月末日	7,297,714,916	-	10,512	-
5月末日	7,358,978,115	-	10,450	-
6月末日	7,449,671,701	-	10,262	-
7月末日	7,818,888,812	-	10,476	-
8月末日	7,902,034,359	-	10,332	-
9月末日	7,780,635,744	-	9,964	-
10月末日	8,041,659,336	-	10,108	-
11月末日	8,198,902,376	-	10,138	-
12月末日	8,214,336,800	-	9,863	-
2023年 1月末日	8,510,116,579	-	10,002	-
2月末日	8,670,226,370	-	9,982	-
3月末日	8,927,158,621	-	10,085	-

## 三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2018年 9月18日)	95,425,714	95,425,714	10,023	10,023
第2期 (2019年 9月17日)	680,523,123	680,523,123	10,310	10,310
第3期 (2020年 9月15日)	1,423,870,207	1,423,870,207	10,504	10,504

第4期 (2021年 9月15日)	2,948,746,361	2,948,746,361	11,770	11,770
第5期 (2022年 9月15日)	3,963,474,003	3,963,474,003	11,317	11,317
2022年 3月末日	3,602,583,975	-	11,647	-
4月末日	3,587,366,723	-	11,418	-
5月末日	3,642,065,089	-	11,360	-
6月末日	3,662,182,964	-	11,159	-
7月末日	3,851,864,230	-	11,428	-
8月末日	3,926,644,737	-	11,330	-
9月末日	3,840,302,989	-	10,872	-
10月末日	4,088,509,649	-	11,168	-
11月末日	4,110,112,962	-	11,187	-
12月末日	4,086,920,408	-	10,807	-
2023年 1月末日	4,264,317,085	-	11,025	-
2月末日	4,364,227,935	-	11,058	-
3月末日	4,489,153,663	-	11,136	-

## 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2018年 9月18日)	294,119,586	294,119,586	10,265	10,265
第2期 (2019年 9月17日)	1,355,636,779	1,355,636,779	10,443	10,443
第3期 (2020年 9月15日)	3,340,276,783	3,340,276,783	10,752	10,752
第4期 (2021年 9月15日)	7,103,911,189	7,103,911,189	12,649	12,649
第5期 (2022年 9月15日)	10,302,370,297	10,302,370,297	12,461	12,461
2022年 3月末日	8,959,889,546	-	12,707	-
4月末日	9,073,061,901	-	12,420	-
5月末日	9,292,559,804	-	12,371	-
6月末日	9,401,111,707	-	12,157	-
7月末日	9,912,955,527	-	12,479	-
8月末日	10,170,398,075	-	12,433	-
9月末日	9,998,883,822	-	11,865	-
10月末日	10,707,304,443	-	12,322	-
11月末日	10,942,697,015	-	12,338	-
12月末日	10,781,847,700	-	11,842	-
2023年 1月末日	11,263,127,727	-	12,152	-
2月末日	11,657,452,296	-	12,237	-
3月末日	11,925,310,654	-	12,286	-

## 三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)

第1期 (2018年 9月18日)	198,459,464	198,459,464	10,365	10,365
第2期 (2019年 9月17日)	635,299,500	635,299,500	10,455	10,455
第3期 (2020年 9月15日)	1,407,129,947	1,407,129,947	10,813	10,813
第4期 (2021年 9月15日)	2,920,936,967	2,920,936,967	13,299	13,299
第5期 (2022年 9月15日)	4,630,827,047	4,630,827,047	13,380	13,380
2022年 3月末日	3,945,549,988	-	13,526	-
4月末日	3,982,993,589	-	13,181	-
5月末日	4,088,692,125	-	13,144	-
6月末日	4,185,355,610	-	12,932	-
7月末日	4,417,687,775	-	13,283	-
8月末日	4,582,453,867	-	13,308	-
9月末日	4,448,829,413	-	12,634	-
10月末日	4,832,793,949	-	13,226	-
11月末日	4,967,775,390	-	13,258	-
12月末日	4,903,357,145	-	12,658	-
2023年 1月末日	5,123,084,287	-	13,064	-
2月末日	5,282,721,900	-	13,197	-
3月末日	5,385,865,576	-	13,204	-

## 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2018年 9月18日)	475,256,788	475,256,788	10,445	10,445
第2期 (2019年 9月17日)	758,503,160	758,503,160	10,399	10,399
第3期 (2020年 9月15日)	1,374,244,182	1,374,244,182	10,821	10,821
第4期 (2021年 9月15日)	2,928,938,274	2,928,938,274	13,753	13,753
第5期 (2022年 9月15日)	4,578,888,251	4,578,888,251	14,067	14,067
2022年 3月末日	3,959,702,951	-	14,118	-
4月末日	3,926,672,761	-	13,707	-
5月末日	4,045,780,318	-	13,699	-
6月末日	4,147,618,070	-	13,504	-
7月末日	4,365,497,150	-	13,852	-
8月末日	4,515,945,280	-	13,951	-
9月末日	4,380,544,719	-	13,190	-
10月末日	4,735,827,526	-	13,883	-
11月末日	4,898,665,102	-	13,951	-
12月末日	4,832,351,578	-	13,266	-
2023年 1月末日	5,058,810,979	-	13,776	-
2月末日	5,220,501,100	-	13,938	-
3月末日	5,343,537,213	-	13,928	-

## 【分配の推移】

## 三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	2017年 9月14日～2018年 9月18日	0
第2期	2018年 9月19日～2019年 9月17日	0
第3期	2019年 9月18日～2020年 9月15日	0
第4期	2020年 9月16日～2021年 9月15日	0
第5期	2021年 9月16日～2022年 9月15日	0

## 三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	2017年 9月14日～2018年 9月18日	0
第2期	2018年 9月19日～2019年 9月17日	0
第3期	2019年 9月18日～2020年 9月15日	0
第4期	2020年 9月16日～2021年 9月15日	0
第5期	2021年 9月16日～2022年 9月15日	0

## 三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	2017年 9月14日～2018年 9月18日	0
第2期	2018年 9月19日～2019年 9月17日	0
第3期	2019年 9月18日～2020年 9月15日	0
第4期	2020年 9月16日～2021年 9月15日	0
第5期	2021年 9月16日～2022年 9月15日	0

## 三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	2017年 9月14日～2018年 9月18日	0
第2期	2018年 9月19日～2019年 9月17日	0
第3期	2019年 9月18日～2020年 9月15日	0
第4期	2020年 9月16日～2021年 9月15日	0
第5期	2021年 9月16日～2022年 9月15日	0

## 三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	2017年 9月14日～2018年 9月18日	0
第2期	2018年 9月19日～2019年 9月17日	0
第3期	2019年 9月18日～2020年 9月15日	0
第4期	2020年 9月16日～2021年 9月15日	0
第5期	2021年 9月16日～2022年 9月15日	0

## 【収益率の推移】

## 三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）

	収益率（％）
第1期	1.1
第2期	4.4
第3期	0.2
第4期	6.1
第5期	6.5
第6期（中間期）	2.7

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

## 三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）

	収益率（％）
第1期	0.2
第2期	2.9
第3期	1.9
第4期	12.1
第5期	3.8
第6期（中間期）	2.8

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

## 三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）

	収益率（％）
第1期	2.7
第2期	1.7
第3期	3.0
第4期	17.6
第5期	1.5
第6期（中間期）	2.9

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

## 三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）

	収益率（％）
第1期	3.7
第2期	0.9
第3期	3.4



第4期	23.0
第5期	0.6
第6期(中間期)	3.2

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

#### 三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)

	収益率(%)
第1期	4.5
第2期	0.4
第3期	4.1
第4期	27.1
第5期	2.3
第6期(中間期)	3.2

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

#### (4)【設定及び解約の実績】

#### 三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	197,260,985	6,814,601
第2期	1,242,016,819	118,444,252
第3期	2,142,530,997	364,184,551
第4期	3,074,461,766	692,313,957
第5期	3,272,525,772	1,024,474,042
第6期(中間期)	1,468,004,978	453,170,146

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

#### 三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	235,257,377	140,052,522
第2期	593,034,885	28,199,968
第3期	853,822,366	158,356,618
第4期	1,391,060,134	241,319,938
第5期	1,327,482,394	330,475,830
第6期(中間期)	665,338,792	185,954,711

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

#### 三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)

	設定口数(口)	解約口数(口)

第1期	426,008,460	139,473,752
第2期	1,111,549,352	100,006,600
第3期	2,085,818,899	277,142,914
第4期	2,996,875,916	487,585,479
第5期	3,415,030,451	763,606,832
第6期(中間期)	1,660,178,027	320,192,638

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

#### 三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	411,158,724	219,693,175
第2期	485,641,046	69,477,173
第3期	839,231,080	145,565,103
第4期	1,186,838,860	291,846,934
第5期	1,638,627,128	373,806,038
第6期(中間期)	771,225,588	216,441,673

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

#### 三井住友・資産最適化ファンド(5 成長重視型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	762,271,388	307,261,790
第2期	481,502,084	207,078,502
第3期	843,783,098	303,192,666
第4期	1,274,331,650	414,699,900
第5期	1,564,567,682	439,177,712
第6期(中間期)	758,688,628	229,419,830

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

(参考)

(1) 投資状況

#### 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

2023年3月31日現在

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

その他以下の取引を行っております。

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

## 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

### 国内債券パッシブ・マザーファンド

2023年3月31日現在

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

### 外国債券パッシブ・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

## 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

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

## イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2023年3月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	4,322,700	2,003.94	8,662,426,621	1,880.00	8,126,676,000	3.50
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	556,900	11,229.38	6,253,640,431	11,985.00	6,674,446,500	2.88
日本	株式	キーエンス	電気機器	78,800	56,990.98	4,490,889,460	64,450.00	5,078,660,000	2.19
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	4,854,300	758.24	3,680,714,582	847.90	4,115,960,970	1.77
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,011,800	3,819.11	3,864,178,941	3,962.00	4,008,751,600	1.73
日本	株式	第一三共	医薬品	687,900	4,505.87	3,099,590,775	4,822.00	3,317,053,800	1.43
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	698,600	4,052.33	2,830,959,043	4,350.00	3,038,910,000	1.31
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	566,200	4,700.62	2,661,490,658	5,298.00	2,999,727,600	1.29
日本	株式	日立製作所	電気機器	386,600	7,280.42	2,814,609,440	7,252.00	2,803,623,200	1.21
日本	株式	信越化学工業	化学	655,000	3,512.39	2,300,612,877	4,275.00	2,800,125,000	1.21
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	166,500	14,974.95	2,493,329,721	16,040.00	2,670,660,000	1.15
日本	株式	任天堂	その他製品	497,100	5,882.36	2,924,119,453	5,131.00	2,550,620,100	1.10
日本	株式	三井物産	卸売業	609,400	3,977.64	2,423,973,691	4,116.00	2,508,290,400	1.08
日本	株式	KDDI	情報・通信業	610,300	4,106.82	2,506,393,321	4,093.00	2,497,957,900	1.08
日本	株式	三菱商事	卸売業	520,800	4,592.51	2,391,776,691	4,751.00	2,474,320,800	1.07
日本	株式	H O Y A	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 - CL 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	大和ハウスイリート 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	アクティブピア・プ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	SEGR0 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

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

### イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2023年3月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債 証券	4 4 4 2 年国債	3,050,000,000	99.94	3,048,170,000	100.18	3,055,581,500	0.005	2025/01/01	2.52
日本	国債 証券	3 6 3 1 0年国債	1,610,000,000	98.77	1,590,263,900	98.20	1,581,003,900	0.100	2031/06/20	1.30
日本	国債 証券	1 4 7 5 年国債	1,310,000,000	100.17	1,312,227,000	100.18	1,312,318,700	0.005	2026/03/20	1.08
日本	国債 証券	1 5 6 5 年国債	1,270,000,000	99.94	1,269,238,000	100.54	1,276,858,000	0.200	2027/12/20	1.05
日本	国債 証券	1 4 9 5 年国債	1,240,000,000	100.15	1,241,872,400	100.10	1,241,289,600	0.005	2026/09/20	1.02
日本	国債 証券	1 5 0 5 年国債	1,230,000,000	100.13	1,231,642,400	100.02	1,230,221,400	0.005	2026/12/20	1.01
日本	国債 証券	1 4 5 5 年国債	1,180,000,000	100.49	1,185,778,800	100.43	1,185,097,600	0.100	2025/09/20	0.98
日本	国債 証券	1 5 3 5 年国債	1,140,000,000	99.19	1,130,740,500	99.85	1,138,312,800	0.005	2027/06/20	0.94
日本	国債 証券	1 4 8 5 年国債	1,130,000,000	100.15	1,131,695,000	100.16	1,131,808,000	0.005	2026/06/20	0.93
日本	国債 証券	3 6 2 1 0年国債	1,150,000,000	99.22	1,140,979,000	98.41	1,131,669,000	0.100	2031/03/20	0.93
日本	国債 証券	3 6 9 1 0年国債	1,110,000,000	100.00	1,110,022,200	101.70	1,128,814,500	0.500	2032/12/20	0.93
日本	国債 証券	1 5 4 5 年国債	1,020,000,000	99.87	1,018,674,000	100.18	1,021,815,600	0.100	2027/09/20	0.84
日本	国債 証券	1 4 6 5 年国債	1,000,000,000	100.52	1,005,167,200	100.45	1,004,480,000	0.100	2025/12/20	0.83
日本	国債 証券	3 5 9 1 0年国債	1,000,000,000	99.51	995,133,000	99.08	990,770,000	0.100	2030/06/20	0.82

日本	国債証券	1445年国債	980,000,000	100.48	984,664,800	100.40	983,910,200	0.100	2025/06/20	0.81
日本	国債証券	36110年国債	980,000,000	98.50	965,311,400	98.64	966,672,000	0.100	2030/12/20	0.80
日本	国債証券	35810年国債	940,000,000	99.68	936,965,600	99.25	932,903,000	0.100	2030/03/20	0.77
日本	国債証券	36010年国債	910,000,000	99.55	905,915,600	98.90	899,990,000	0.100	2030/09/20	0.74
日本	国債証券	15120年国債	840,000,000	107.51	903,109,100	107.04	899,102,400	1.200	2034/12/20	0.74
日本	国債証券	36510年国債	890,000,000	99.06	881,634,000	98.05	872,653,900	0.100	2031/12/20	0.72
日本	国債証券	35610年国債	850,000,000	98.57	837,870,400	99.49	845,648,000	0.100	2029/09/20	0.70
日本	国債証券	36710年国債	840,000,000	99.87	838,908,000	99.59	836,589,600	0.200	2032/06/20	0.69
日本	国債証券	34410年国債	811,000,000	100.56	815,557,820	100.43	814,511,630	0.100	2026/09/20	0.67
日本	国債証券	33810年国債	805,000,000	101.30	815,440,850	100.96	812,744,100	0.400	2025/03/20	0.67
日本	国債証券	8820年国債	742,000,000	109.51	812,586,460	107.56	798,124,880	2.300	2026/06/20	0.66
日本	国債証券	33910年国債	785,000,000	101.40	795,974,300	101.06	793,352,400	0.400	2025/06/20	0.65
日本	国債証券	34010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	1435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	36410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	35410年国債	695,000,000	100.06	695,417,000	99.73	693,151,300	0.100	2029/03/20	0.57

## □ 種類別投資比率

2023年3月31日現在

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

## 外国債券パッシブ・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

## ロ 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

## 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

投資不動産物件

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

## エマージング株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

## Jリート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

## 外国リート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

## 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

2023年3月31日現在

種類	国/地域	取引所等	名称	買建/売建	数量	通貨	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
株価指数 先物取引	日本	大阪取引所	TOPIX 先物 0506 月 2023年 6月	買建	275	日本・円	5,418,944,400	5,509,625,000	2.37

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

## 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 EU	FTSE 100 IDX FUT JUN 23 2023 年6月	買建	36	イギリス・ポンド	2,706,632.00	448,109,993	2,744,640.00	454,402,598	0.10
	ドイツ	EU REX	EURO STOX X50 JUN23 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 INI F U T J U N 2 3 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	S P I 2 0 0 F U T U R E S J U N 2 3 2023年6月	買建	22	オーストラリア・ドル	3,880,699.00	348,059,893	3,927,000.00	352,212,630	0.08

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2023年3月31日現在

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	アメリカ・ドル	買建	11,713,000.00	1,540,125,301	1,563,300,406	0.33
	ユーロ	買建	2,207,000.00	317,506,381	321,488,793	0.07
	イギリス・ポンド	買建	619,000.00	100,856,158	102,434,712	0.02
	カナダ・ドル	買建	547,000.00	52,793,759	53,995,135	0.01
	スイス・フラン	買建	355,000.00	50,660,204	51,880,339	0.01
	香港・ドル	買建	2,193,000.00	36,655,995	37,293,500	0.01
	デンマーク・クローネ	買建	1,313,000.00	25,083,814	25,676,634	0.01

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

#### 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	ICE - US	MSCI EMGMK T J U N 2 3 2023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	TREI T 先 物 0506 月 2023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。

#### 国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

#### 外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

#### ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

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。

## 参考情報

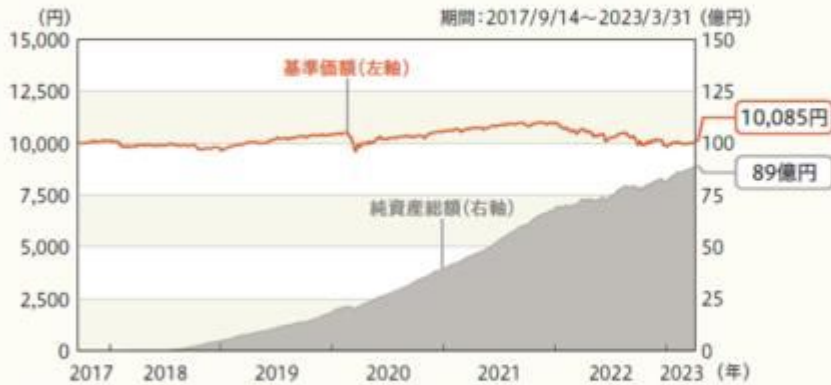
基準日: 2023年3月31日

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

## 基準価額・純資産の推移

## 分配の推移

## ■1 安定重視型



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2022年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。

## ■2 やや安定型



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2022年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。

## ■3 バランス型

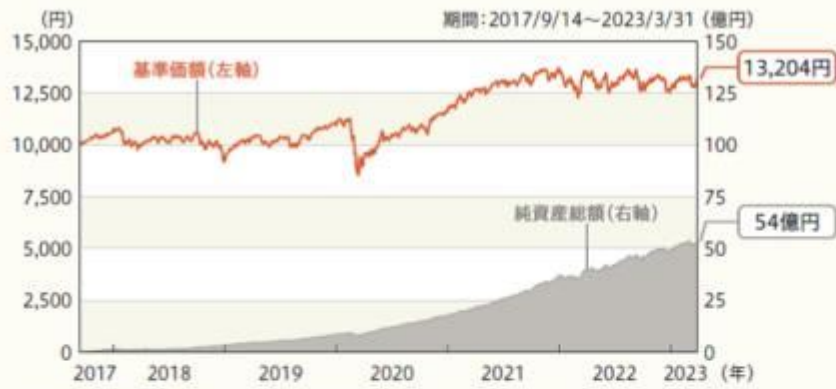


※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2022年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。

## ■ 4 やや成長型



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2022年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。

## ■ 5 成長重視型



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2022年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

### ■1 安定重視型

#### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	96.94
投資証券	アメリカ	1.97
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.09
合計(純資産総額)		100.00

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	40.09
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	30.38
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	10.24
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)	8.27
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	2.06
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	1.99
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	1.97
アメリカ	投資証券	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建て エマージング・マーケット債券 ETF	1.97
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	1.95

### ■2 やや安定型

#### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	96.01
投資証券	アメリカ	2.85
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.14
合計(純資産総額)		100.00

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	30.30
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	20.56
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	18.27
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	15.11
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	2.99
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	2.98
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	2.94
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	2.86
アメリカ	投資証券	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建て エマージング・マーケット債券 ETF	2.85

### ■3 バランス型

#### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	95.10
投資証券	アメリカ	3.81
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.09
合計(純資産総額)		100.00

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	25.28
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	21.13
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)	21.10
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	11.83
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	4.94
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	4.05
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	3.82
アメリカ	投資証券	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建て エマージング・マーケット債券 ETF	3.81
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	2.96

※比率は、ファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

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



## ■4やや成長型

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	94.15
投資証券	アメリカ	4.81
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.04
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	30.07
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)	25.95
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	11.45
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	9.05
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	5.92
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	4.98
アメリカ	投資証券	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建て エマージング・マーケット債券 ETF	4.81
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	4.76
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	1.97

## ■5成長重視型

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	93.21
投資証券	アメリカ	5.73
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.06
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	35.01
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	29.57
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	15.05
アメリカ	投資証券	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建て エマージング・マーケット債券 ETF	5.73
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	3.88
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	3.88
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	3.82
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	1.01
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	1.00

※比率は、ファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

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

## ■国内債券パッシブ・マザーファンド

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

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

## ■外国債券パッシブ・マザーファンド

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

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

## ■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10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	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
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.000	2025/12/15	0.68
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.500	2024/04/30	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.250	2024/05/15	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.375	2025/12/31	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.375	2024/04/15	0.53

※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10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	3.50
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2.88
日本	株式	キーエンス	電気機器	2.19
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.77
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.73
日本	株式	第一三共	医薬品	1.43
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1.31
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.29
日本	株式	日立製作所	電気機器	1.21
日本	株式	信越化学工業	化学	1.21

## ■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10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.11
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	3.98
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	1.85
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	1.33
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	1.19
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1.09
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	1.04
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	0.93
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	0.89
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	0.87

## ■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10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	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
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	2.57
ケイマン諸島	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	1.28
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	1.18
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI UAE ETF	—	1.17
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	0.87

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時値の比率です。



## ■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10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	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
日本	投資証券	GLP投資法人	4.52
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	4.01
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	3.28
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	3.13
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	3.10

## ■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10銘柄)

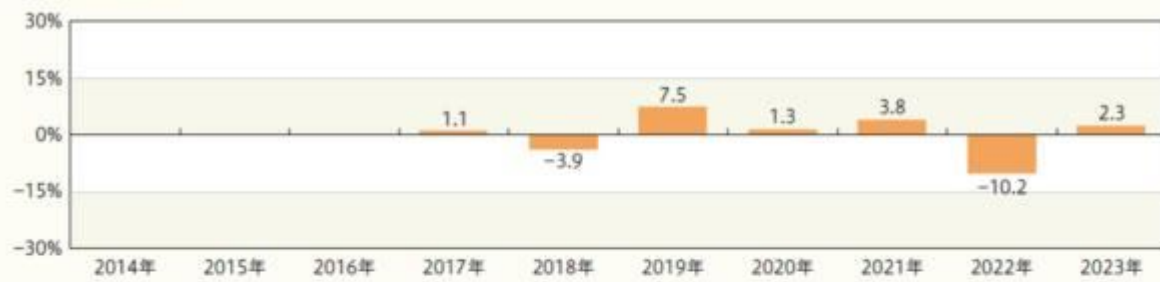
国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	8.98
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	5.20
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	3.74
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	3.15
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	2.83
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	2.67
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	2.53
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	2.15
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	1.84
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	1.72

※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。

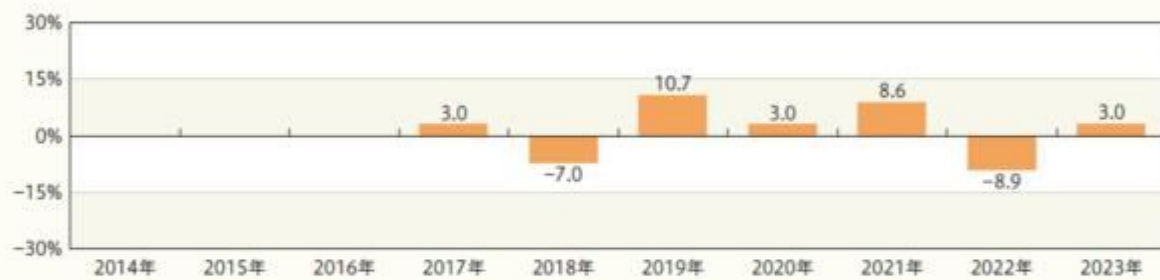


## 年間収益率の推移(暦年ベース)

### ■ 1 安定重視型



### ■ 2 やや安定型



### ■ 3 バランス型



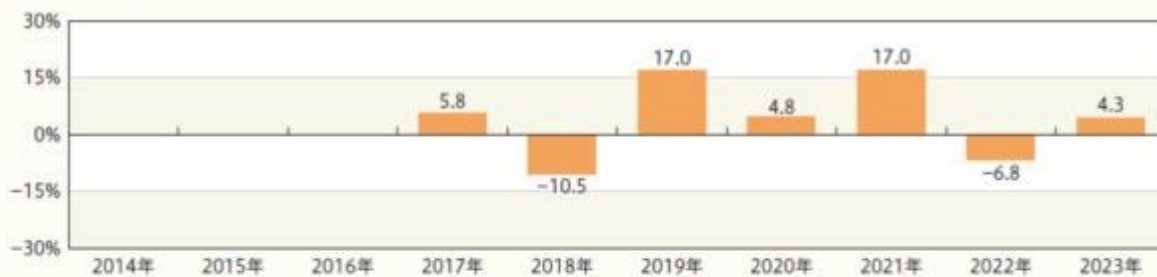
※収益率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しています。分配実績がない場合は、基準価額の騰落率です。

※ファンドが設定された年の収益率は、設定日から年末までの騰落率です。

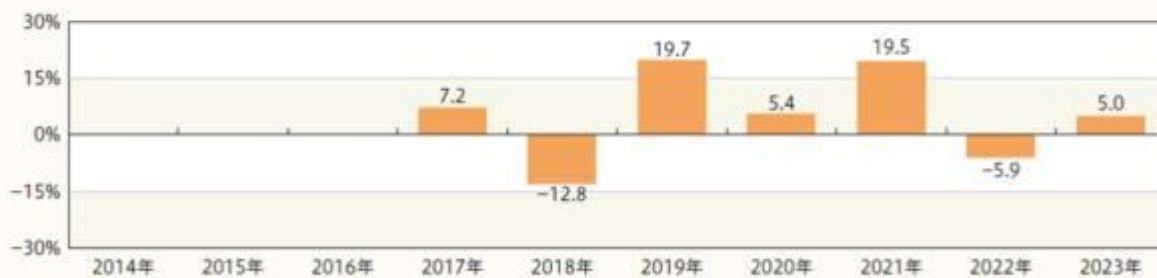
※2023年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。

※ファンドにはベンチマークはありません。

## ■ 4 やや成長型



## ■ 5 成長重視型



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

※ファンドが設定された年の収益率は、設定日から年末までの騰落率です。

※2023年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。

※ファンドにはベンチマークはありません。

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込（販売）手続等】

## イ 申込方法

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

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

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

お申込みの販売会社にお問い合わせください。

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

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

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

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

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

## (ニ) 申込不可日

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

- ・ニューヨークの取引所の休業日
- ・ニューヨークの銀行の休業日

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

ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

ハ 申込手数料

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	<a href="https://www.smd-am.co.jp">https://www.smd-am.co.jp</a>

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

ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

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

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

## 2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

ただし、以下のいずれかに当たる場合には、解約請求の受付は行いません。

- ・ニューヨークの取引所の休業日
- ・ニューヨークの銀行の休業日

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

なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金申込みに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付を中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行請求を取り消すことがあります。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の

請求を撤回できます。受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、上記に準じた取扱いとなります。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### イ 基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産(受入担保金代用有価証券および借入れ有価証券を除きます。)を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額(「純資産総額」といいます。)を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます(基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。)。投資対象とする投資信託証券は、原則として、基準価額計算日に知りうる直近の純資産価格(基準価額)で評価します。また、上場されている場合は、その主たる取引所における最終相場で評価します。投資対象とする親投資信託受益証券は、当該親投資信託受益証券の基準価額で評価します。

なお、外貨建資産の円換算については、原則として日本における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算するものとします。また、予約為替の評価は、原則として日本における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

<マザーファンドの主要投資対象の評価方法>

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

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

##### 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、「1安定重視型」は「最適安定重視」、「2やや安定型」は「最適やや安定」、「3バランス型」は「最適バランス」、「4やや成長型」は「最適やや成長」、「5成長重視型」は「最適成長重視」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

#### (2)【保管】

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

### (3) 【信託期間】

2017年9月14日から2037年9月15日まで、もしくは下記「(5) その他 イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

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

### (4) 【計算期間】

毎年9月16日から翌年9月15日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

### (5) 【その他】

#### イ 信託の終了

##### (イ) 信託契約の解約

- a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、各ファンドにつき残存口数が10億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記aの事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b～dまでの取扱いは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b～dまでの取扱いを行うことが困難な場合も同様とします。

##### (ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令

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

##### (ハ) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

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

は、その委託会社と受託会社との間において存続します。

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

ロ 収益分配金、償還金の支払い

(イ) 収益分配金

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

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

(ロ) 償還金

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

八 信託約款の変更等

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

(ロ) 委託会社は、上記（イ）の事項（変更についてはその内容が重大なものに該当する場合に限  
り、併合にあつては、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、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行  
使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

- (ホ) 上記(ロ)から(ニ)までの取扱いは、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- (ヘ) 上記にかかわらず、当ファンドと他のファンドとの併合の場合は、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、相手方となる他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、併合を行うことはできません。

## ニ 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

## ホ 販売会社との契約の更改等

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

## ヘ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

## ト 公告

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

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

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

## チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

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

## 4【受益者の権利等】

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

### イ 分配金請求権

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

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

ただし、分配金自動再投資コースをお申込みの場合の収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づき、毎計算期間終了日の翌営業日に無手数料で再投資され、再投資

により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

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

ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

ハ 一部解約実行請求権

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

ニ 書面決議における議決権

委託会社が、当ファンドの解約(監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。)または、重大な信託約款の変更等を行おうとする場合において、受益者は、それぞれの書面決議手続きにおいて、受益権の口数に応じて議決権を有しこれを行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16日から2022年9月15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・資産最適化ファンド（1安定重視型）】

## （1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第4期 （2021年 9月15日現在）	第5期 （2022年 9月15日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	712,078	1,257,669
金銭信託	69,555,463	4,663,211
コール・ローン	21,257,972	120,147,047
投資証券	56,709,973	162,750,736
親投資信託受益証券	5,900,624,977	7,694,108,594
流動資産合計	6,048,860,463	7,982,927,257
<b>資産合計</b>		
6,048,860,463		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	8,504,664	9,403,696
未払受託者報酬	860,675	1,245,827
未払委託者報酬	24,385,732	35,299,647
未払利息	54	-
その他未払費用	172,357	249,297
流動負債合計	33,923,482	46,198,467
<b>負債合計</b>		
33,923,482		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	5,474,513,206	7,722,564,936
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	540,423,775	214,163,854
（分配準備積立金）	302,932,197	305,853,457
元本等合計	6,014,936,981	7,936,728,790
<b>純資産合計</b>		
6,014,936,981		
<b>負債純資産合計</b>		
6,048,860,463		

## (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16日 至 2021年 9月15日		自 2021年 9月16日 至 2022年 9月15日	
営業収益				
受取配当金		1,537,243		3,474,029
受取利息		-		1,537
有価証券売買等損益		310,121,613		438,753,028
為替差損益		1,651,391		28,817,706
営業収益合計		313,310,247		406,459,756
営業費用				
支払利息		55,168		36,694
受託者報酬		1,488,563		2,335,221
委託者報酬		42,175,874		66,167,273
その他費用		326,341		491,500
営業費用合計		44,045,946		69,030,688
営業利益又は営業損失( )		269,264,301		475,490,444
経常利益又は経常損失( )		269,264,301		475,490,444
当期純利益又は当期純損失( )		269,264,301		475,490,444
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( )		17,784,843		31,890,097
期首剰余金又は期首欠損金( )		108,754,916		540,423,775
剰余金増加額又は欠損金減少額		208,602,748		213,936,428
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		208,602,748		213,936,428
剰余金減少額又は欠損金増加額		28,413,347		96,596,002
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		28,413,347		96,596,002
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( )		540,423,775		214,163,854

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第5期	
	自 2021年9月16日 至 2022年9月15日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>	

## (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15日現在)	(2022年9月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	5,474,513,206口	7,722,564,936口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0987円 (1万口当たりの純資産額10,987円)	1口当たり純資産額 1.0277円 (1万口当たりの純資産額10,277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16日 至 2021年9月15日	自 2021年9月16日 至 2022年9月15日

分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(61,524,680円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(189,954,778円)、収益調整金(237,491,578円)、および分配準備積立金(51,452,739円)より、分配対象収益は540,423,775円(1万口当たり987.14円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(46,356,972円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(466,888,639円)、および分配準備積立金(259,496,485円)より、分配対象収益は772,742,096円(1万口当たり1,000.63円)であります。分配を行っておりません。
----------	---	--

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	第5期 自 2021年9月16日 至 2022年9月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかると、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15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、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16日 至 2021年9月15日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	198,100円

親投資信託受益証券	291,778,466円
合計	291,976,566円

## 第5期(自 2021年9月16日 至 2022年9月15日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	26,936,645円
親投資信託受益証券	414,723,158円
合計	441,659,803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16日 至 2022年9月15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15日現在)	第5期 (2022年9月15日現在)
期首元本額	3,092,365,397円	5,474,513,206円
期中追加設定元本額	3,074,461,766円	3,272,525,772円
期中一部解約元本額	692,313,957円	1,024,474,042円

## (4)【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 ETF	13,402.00	1,135,417.44	
		アメリカ・ドル小計	13,402.00	1,135,417.44 (162,750,736)	
投資証券合計				162,750,736 (162,750,736)	
親投資信託受益証券	日本・円	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	191,441,180	633,804,314	
		外国株式インデックス・マザーファンド	129,836,552	805,947,412	

	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	2,468,879,015	3,200,407,867	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	77,033,842	158,034,926	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	1,949,732,234	2,422,542,300	
	Jリート・インデックス・マザーファンド	57,002,092	156,208,532	
	外国リート・インデックス・マザーファンド	51,759,489	155,495,856	
	エマージング株式インデックス・マザーファンド	94,365,741	161,667,387	
	日本・円小計	5,020,050,145	7,694,108,594	
親投資信託受益証券合計			7,694,108,594	(-)
合 計			7,856,859,330	(162,750,736)

(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	1銘柄	2.1%	100.0%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。



## 【三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 (2021年 9月15日現在)	第5期 (2022年 9月15日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	708,111	1,045,388
金銭信託	32,628,068	2,168,079
コール・ローン	9,971,992	55,860,282
投資証券	56,486,412	120,417,572
親投資信託受益証券	2,863,033,822	3,803,099,943
未収入金	1,000,000	-
流動資産合計	2,963,828,405	3,982,591,264
資産合計		
	2,963,828,405	3,982,591,264
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	2,898,436	963,313
未払受託者報酬	412,530	614,644
未払委託者報酬	11,688,481	17,416,340
未払利息	25	-
その他未払費用	82,572	122,964
流動負債合計	15,082,044	19,117,261
負債合計		
	15,082,044	19,117,261
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,505,245,716	3,502,252,280
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	443,500,645	461,221,723
(分配準備積立金)	259,635,169	261,960,471
元本等合計	2,948,746,361	3,963,474,003
純資産合計		
	2,948,746,361	3,963,474,003
負債純資産合計		
	2,963,828,405	3,982,591,264

## (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16日 至 2021年 9月15日		自 2021年 9月16日 至 2022年 9月15日	
営業収益				
受取配当金		1,468,353		3,266,989
受取利息		-		931
有価証券売買等損益		252,693,601		127,755,456
為替差損益		1,566,353		25,288,804
営業収益合計		255,728,307		99,198,732
営業費用				
支払利息		24,210		17,239
受託者報酬		698,421		1,146,767
委託者報酬		19,788,684		32,494,085
その他費用		167,051		252,220
営業費用合計		20,678,366		33,910,311
営業利益又は営業損失( )		235,049,941		133,109,043
経常利益又は経常損失( )		235,049,941		133,109,043
当期純利益又は当期純損失( )		235,049,941		133,109,043
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( )		13,603,966		6,547,826
期首剰余金又は期首欠損金( )		68,364,687		443,500,645
剰余金増加額又は欠損金減少額		169,409,323		201,861,837
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		169,409,323		201,861,837
剰余金減少額又は欠損金増加額		15,719,340		57,579,542
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		15,719,340		57,579,542
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( )		443,500,645		461,221,723

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第5期	
	自 2021年9月16日 至 2022年9月15日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>	

## ( 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15日現在 )	( 2022年9月15日現在 )
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,505,245,716口	3,502,252,280口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1770円 ( 1万口当たりの純資産額11,770円 )	1口当たり純資産額 1.1317円 ( 1万口当たりの純資産額11,317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16日 至 2021年9月15日	自 2021年9月16日 至 2022年9月15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(33,666,558円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(187,779,417円)、収益調整金(183,865,476円)、および分配準備積立金(38,189,194円)より、分配対象収益は443,500,645円(1万口当たり1,770.26円)ですが、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(29,695,035円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(288,746,608円)、および分配準備積立金(232,265,436円)より、分配対象収益は550,707,079円(1万口当たり1,572.44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16日 至 2022年9月15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、投資証券、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかると、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15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、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16日 至 2021年9月15日）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	269,371円

親投資信託受益証券	239,985,568円
合計	240,254,939円

## 第5期(自 2021年9月16日 至 2022年9月15日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	24,831,577円
親投資信託受益証券	106,716,300円
合計	131,547,877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16日 至 2022年9月15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15日現在)	第5期 (2022年9月15日現在)
期首元本額	1,355,505,520円	2,505,245,716円
期中追加設定元本額	1,391,060,134円	1,327,482,394円
期中一部解約元本額	241,319,938円	330,475,830円

## (4)【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 ETF	9,916.00	840,083.52	
		アメリカ・ドル小計	9,916.00	840,083.52 (120,417,572)	
投資証券合計				120,417,572 (120,417,572)	
親投資信託受益証券	日本・円	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	177,791,284	588,613,603	
		外国株式インデックス・マザーファンド	115,457,713	716,692,207	

	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	934,024,678	1,210,776,190	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	57,841,285	118,661,396	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	655,230,772	814,124,234	
	Jリート・インデックス・マザーファンド	42,983,263	117,791,333	
	外国リート・インデックス・マザーファンド	38,646,421	116,101,577	
	エマージング株式インデックス・マザーファンド	70,242,472	120,339,403	
	日本・円小計	2,092,217,888	3,803,099,943	
親投資信託受益証券合計			3,803,099,943	(-)
合 計			3,923,517,515	(120,417,572)

(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	1銘柄	3.0%	100.0%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 (2021年 9月15日現在)	第5期 (2022年 9月15日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	2,227,085	3,640,586
金銭信託	79,433,439	5,679,420
コール・ローン	24,276,941	146,329,563
投資証券	203,328,728	412,402,253
親投資信託受益証券	6,833,517,740	9,786,805,117
未収入金	500,000	-
流動資産合計	7,143,283,933	10,354,856,939
資産合計		
	7,143,283,933	10,354,856,939
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	9,891,453	6,181,920
未払受託者報酬	998,227	1,567,833
未払委託者報酬	28,283,084	44,423,140
未払利息	62	-
その他未払費用	199,918	313,749
流動負債合計	39,372,744	52,486,642
負債合計		
	39,372,744	52,486,642
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	5,616,043,882	8,267,467,501
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,487,867,307	2,034,902,796
(分配準備積立金)	883,287,208	880,136,329
元本等合計	7,103,911,189	10,302,370,297
純資産合計		
	7,103,911,189	10,302,370,297
負債純資産合計		
	7,143,283,933	10,354,856,939



## (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16日	自	2021年 9月16日
	至	2021年 9月15日	至	2022年 9月15日
営業収益				
受取配当金		5,300,491		11,892,563
受取利息		-		3,367
有価証券売買等損益		839,020,719		130,357,880
為替差損益		5,766,697		90,191,961
営業収益合計		850,087,907		28,269,989
営業費用				
支払利息		59,036		42,218
受託者報酬		1,681,215		2,866,510
委託者報酬		47,634,192		81,220,041
その他費用		384,244		621,442
営業費用合計		49,758,687		84,750,211
営業利益又は営業損失( )		800,329,220		113,020,200
経常利益又は経常損失( )		800,329,220		113,020,200
当期純利益又は当期純損失( )		800,329,220		113,020,200
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( )		43,955,365		12,350,550
期首剰余金又は期首欠損金( )		233,523,338		1,487,867,307
剰余金増加額又は欠損金減少額		544,667,038		848,326,542
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		544,667,038		848,326,542
剰余金減少額又は欠損金増加額		46,696,924		200,621,403
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		46,696,924		200,621,403
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( )		1,487,867,307		2,034,902,796

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第5期	
	自 2021年9月16日 至 2022年9月15日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>	

## ( 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15日現在 )	( 2022年9月15日現在 )
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	5,616,043,882口	8,267,467,501口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2649円 ( 1万口当たりの純資産額12,649円 )	1口当たり純資産額 1.2461円 ( 1万口当たりの純資産額12,461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16日 至 2021年9月15日	自 2021年9月16日 至 2022年9月15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(88,138,489円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(668,235,366円)、収益調整金(604,580,099円)、および分配準備積立金(126,913,353円)より、分配対象収益は1,487,867,307円(1万口当たり2,649.29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(90,122,079円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(1,154,766,467円)、および分配準備積立金(790,014,250円)より、分配対象収益は2,034,902,796円(1万口当たり2,461.34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16日 至 2022年9月15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、投資証券、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第5期 (2022年9月15日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券（投資証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第4期（自 2020年9月16日 至 2021年9月15日）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	1,163,135円

親投資信託受益証券	814,932,786円
合計	816,095,921円

## 第5期(自 2021年9月16日 至 2022年9月15日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	89,445,257円
親投資信託受益証券	46,658,789円
合計	136,104,046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16日 至 2022年9月15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15日現在)	第5期 (2022年9月15日現在)
期首元本額	3,106,753,445円	5,616,043,882円
期中追加設定元本額	2,996,875,916円	3,415,030,451円
期中一部解約元本額	487,585,479円	763,606,832円

## (4)【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 E T F	33,960.00	2,877,091.20	
		アメリカ・ドル小計	33,960.00	2,877,091.20 (412,402,253)	
投資証券合計				412,402,253 (412,402,253)	
親投資信託受益証券	日本・円	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	646,292,493	2,139,680,556	
		外国株式インデックス・マザーファンド	417,317,703	2,590,457,909	

	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	1,711,684,274	2,218,856,324	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	150,738,817	309,240,683	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	970,730,653	1,206,132,836	
	Jリート・インデックス・マザーファンド	148,291,027	406,376,730	
	外国リート・インデックス・マザーファンド	134,204,157	403,176,128	
	エマージング株式インデックス・マザーファンド	299,371,907	512,883,951	
	日本・円小計	4,478,631,031	9,786,805,117	
親投資信託受益証券合計			9,786,805,117	
			(-)	
合 計			10,199,207,370	
			(412,402,253)	

(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 1銘柄	4.0%	100.0%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 (2021年 9月15日現在)	第5期 (2022年 9月15日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	1,313,521	2,197,443
金銭信託	37,882,378	2,499,260
コール・ローン	11,577,847	64,393,113
投資証券	111,022,876	235,552,606
親投資信託受益証券	2,780,667,172	4,349,539,379
未収入金	-	5,000,000
流動資産合計	2,942,463,794	4,659,181,801
資産合計		
	2,942,463,794	4,659,181,801
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	9,482,951	7,830,467
未払受託者報酬	407,802	694,909
未払委託者報酬	11,554,398	19,690,349
未払利息	29	-
その他未払費用	81,647	139,029
流動負債合計	21,526,827	28,354,754
負債合計		
	21,526,827	28,354,754
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,196,287,325	3,461,108,415
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	724,649,642	1,169,718,632
(分配準備積立金)	433,908,706	424,973,670
元本等合計	2,920,936,967	4,630,827,047
純資産合計		
	2,920,936,967	4,630,827,047
負債純資産合計		
	2,942,463,794	4,659,181,801

## (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16日	至 2021年 9月15日	自 2021年 9月16日	至 2022年 9月15日
<b>営業収益</b>				
受取配当金	2,887,297		6,918,609	
受取利息	-		1,555	
有価証券売買等損益	423,520,779		13,259,517	
為替差損益	3,059,981		51,711,109	
営業収益合計	429,468,057		71,890,790	
<b>営業費用</b>				
支払利息	24,472		19,548	
受託者報酬	685,655		1,251,141	
委託者報酬	19,426,802		35,451,279	
その他費用	175,738		292,281	
営業費用合計	20,312,667		37,014,249	
営業利益又は営業損失( )	409,155,390		34,876,541	
経常利益又は経常損失( )	409,155,390		34,876,541	
当期純利益又は当期純損失( )	409,155,390		34,876,541	
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( )	33,953,834		4,208,097	
期首剰余金又は期首欠損金( )	105,834,548		724,649,642	
剰余金増加額又は欠損金減少額	275,638,977		528,923,034	
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	275,638,977		528,923,034	
剰余金減少額又は欠損金増加額	32,025,439		122,938,682	
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	32,025,439		122,938,682	
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( )	724,649,642		1,169,718,632	



## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第5期	
	自 2021年9月16日 至 2022年9月15日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>	

## ( 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15日現在 )	( 2022年9月15日現在 )
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,196,287,325口	3,461,108,415口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.3299円 ( 1万口当たりの純資産額13,299円 )	1口当たり純資産額 1.3380円 ( 1万口当たりの純資産額13,380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16日 至 2021年9月15日	自 2021年9月16日 至 2022年9月15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(38,272,378円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(336,929,178円)、収益調整金(290,740,936円)、および分配準備積立金(58,707,150円)より、分配対象収益は724,649,642円(1万口当たり3,299.39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(45,568,967円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(744,744,962円)、および分配準備積立金(379,404,703円)より、分配対象収益は1,169,718,632円(1万口当たり3,379.61円)ですが、分配を行っておりません。</p>
----------	--	---

## (金融商品に関する注記)

## ・金融商品の状況に関する事項

項目	第5期 自 2021年9月16日 至 2022年9月15日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかると、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15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、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16日 至 2021年9月15日）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	609,818円

親投資信託受益証券	407,400,818円
合計	408,010,636円

## 第5期(自 2021年9月16日 至 2022年9月15日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	52,112,690円
親投資信託受益証券	65,593,684円
合計	13,480,994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16日 至 2022年9月15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15日現在)	第5期 (2022年9月15日現在)
期首元本額	1,301,295,399円	2,196,287,325円
期中追加設定元本額	1,186,838,860円	1,638,627,128円
期中一部解約元本額	291,846,934円	373,806,038円

## (4)【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 ETF	19,397.00	1,643,313.84	
		アメリカ・ドル小計	19,397.00	1,643,313.84 (235,552,606)	
投資証券合計				235,552,606 (235,552,606)	
親投資信託受益証券	日本・円	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	358,413,998	1,186,601,223	
		外国株式インデックス・マザーファンド	222,642,765	1,382,032,699	

	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	418,843,195	542,946,433	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	45,415,312	93,169,512	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	217,690,587	270,480,554	
	Jリート・インデックス・マザーファンド	83,664,634	229,274,563	
	外国リート・インデックス・マザーファンド	75,760,513	227,599,733	
	エマージング株式インデックス・マザーファンド	243,657,870	417,434,662	
	日本・円小計	1,666,088,874	4,349,539,379	
親投資信託受益証券合計			4,349,539,379	(-)
合 計			4,585,091,985	(235,552,606)

(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 1銘柄	5.1%	100.0%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 (2021年 9月15日現在)	第5期 (2022年 9月15日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	1,646,876	2,630,775
金銭信託	35,363,860	2,598,956
コール・ローン	10,808,122	66,961,766
投資証券	137,042,892	278,262,227
親投資信託受益証券	2,762,355,763	4,254,947,241
未収入金	4,000,000	26,000,000
流動資産合計	2,951,217,513	4,631,400,965
資産合計	2,951,217,513	4,631,400,965
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	10,066,584	32,201,148
未払受託者報酬	413,521	687,701
未払委託者報酬	11,716,331	19,486,277
未払利息	27	-
その他未払費用	82,776	137,588
流動負債合計	22,279,239	52,512,714
負債合計	22,279,239	52,512,714
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,129,655,362	3,255,045,332
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	799,282,912	1,323,842,919
(分配準備積立金)	469,596,083	504,262,684
元本等合計	2,928,938,274	4,578,888,251
純資産合計	2,928,938,274	4,578,888,251
負債純資産合計	2,951,217,513	4,631,400,965

## (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16日	至 2021年 9月15日	自 2021年 9月16日	至 2022年 9月15日
<b>営業収益</b>				
受取配当金	3,603,100		8,632,871	
受取利息	-		1,749	
有価証券売買等損益	477,319,628		71,139,116	
為替差損益	3,947,992		62,824,027	
営業収益合計	484,870,720		142,597,763	
<b>営業費用</b>				
支払利息	26,581		19,527	
受託者報酬	686,219		1,236,465	
委託者報酬	19,442,794		35,035,972	
その他費用	188,815		295,570	
営業費用合計	20,344,409		36,587,534	
営業利益又は営業損失( )	464,526,311		106,010,229	
経常利益又は経常損失( )	464,526,311		106,010,229	
当期純利益又は当期純損失( )	464,526,311		106,010,229	
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( )	54,458,805		539,893	
期首剰余金又は期首欠損金( )	104,220,570		799,282,912	
剰余金増加額又は欠損金減少額	335,253,054		583,735,762	
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	335,253,054		583,735,762	
剰余金減少額又は欠損金増加額	50,258,218		164,646,091	
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	50,258,218		164,646,091	
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( )	799,282,912		1,323,842,919	

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第5期	
	自 2021年9月16日 至 2022年9月15日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>	

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第4期	第5期
	(2021年9月15日現在)	(2022年9月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,129,655,362口	3,255,045,332口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.3753円 (1万口当たりの純資産額13,753円)	1口当たり純資産額 1.4067円 (1万口当たりの純資産額14,067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16日 至 2021年9月15日	自 2021年9月16日 至 2022年9月15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(38,425,492円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(371,642,014円)、収益調整金(329,686,829円)、および分配準備積立金(59,528,577円)より、分配対象収益は799,282,912円(1万口当たり3,753.09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(63,333,385円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(42,136,951円)、収益調整金(819,580,235円)、および分配準備積立金(398,792,348円)より、分配対象収益は1,323,842,919円(1万口当たり4,067.05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16日 至 2022年9月15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、投資証券、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかると、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15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、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16日 至 2021年9月15日）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	667,812円

親投資信託受益証券	456,935,062円
合計	457,602,874円

## 第5期(自 2021年9月16日 至 2022年9月15日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	63,952,362円
親投資信託受益証券	130,415,429円
合計	66,463,067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16日 至 2022年9月15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15日現在)	第5期 (2022年9月15日現在)
期首元本額	1,270,023,612円	2,129,655,362円
期中追加設定元本額	1,274,331,650円	1,564,567,682円
期中一部解約元本額	414,699,900円	439,177,712円

## (4)【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券 E T F	22,914.00	1,941,274.08	
		アメリカ・ドル小計	22,914.00	1,941,274.08 (278,262,227)	
投資証券合計				278,262,227 (278,262,227)	
親投資信託受益証券	日本・円	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	411,029,732	1,360,796,133	
		外国株式インデックス・マザーファンド	255,210,888	1,584,196,066	

	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	135,457,382	175,593,404	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	22,253,366	45,652,780	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	35,698,724	44,355,664	
	Jリート・インデックス・マザーファンド	65,470,159	179,414,423	
	外国リート・インデックス・マザーファンド	59,288,519	178,114,568	
	エマージング株式インデックス・マザーファンド	400,901,356	686,824,203	
	日本・円小計	1,385,310,126	4,254,947,241	
親投資信託受益証券合計			4,254,947,241	(-)
合 計			4,533,209,468	(278,262,227)

(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 1銘柄	6.1%	100.0%

#### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

#### (参考)

「三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)」、「三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)」、「三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)」、「三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)」および「三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)」は、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「エマージング株式インデックス・マザーファンド」、「Jリート・インデックス・マザーファンド」、「外国リート・インデックス・マザーファンド」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」および「ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。  
なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

#### 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

##### (1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2021年9月15日現在)	(2022年9月15日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,369,477,101	127,108,074
コール・ローン	418,494,954	3,274,923,761

株式	206,353,778,940	211,443,637,940
派生商品評価勘定	-	34,489,000
未収入金	2,073,632,542	80,311,086
未収配当金	73,575,334	94,269,554
前払金	5,175,000	-
差入委託証拠金	64,260,000	136,125,000
流動資産合計	210,358,393,871	215,190,864,415
資産合計	210,358,393,871	215,190,864,415
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	5,195,900	7,389,700
前受金	-	17,130,000
未払金	4,997,200	-
未払解約金	1,690,662,689	92,522,517
未払利息	1,080	-
その他未払費用	6,624	3,957
流動負債合計	1,700,863,493	117,046,174
負債合計	1,700,863,493	117,046,174
純資産の部		
元本等		
元本	60,058,250,145	64,962,611,793
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	148,599,280,233	150,111,206,448
元本等合計	208,657,530,378	215,073,818,241
純資産合計	208,657,530,378	215,073,818,241
負債純資産合計	210,358,393,871	215,190,864,415

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2021年9月16日 至 2022年9月15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。

## (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15日現在)	(2022年9月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	60,058,250,145口	64,962,611,793口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.4743円 (1万口当たりの純資産額34,743円)	1口当たり純資産額 3.3107円 (1万口当たりの純資産額33,107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16日 至 2022年9月15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15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15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	1,213,045,900	-	1,207,850,000	5,195,900
	小計	1,213,045,900	-	1,207,850,000	5,195,900
合計		1,213,045,900	-	1,207,850,000	5,195,900

(2022年9月15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	3,587,610,700	-	3,614,710,000	27,099,300
	小計	3,587,610,700	-	3,614,710,000	27,099,300
合計		3,587,610,700	-	3,614,710,000	27,099,300

(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16日 至 2022年9月15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15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	65,691,116,604円
同期中における追加設定元本額	9,882,098,470円
同期中における一部解約元本額	15,514,964,929円
2021年9月15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	9,376,871,564円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	887,766,025円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,301,188,303円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,260,072,245円



SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	143,139,510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)	141,195,904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)	115,860,274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)	212,417,736円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,169,108,063円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	17,489,497,601円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	200,770,021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)	132,908,125円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	447,303,446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)	260,317,035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	384,768,338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	396,551円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,864,988,898円
バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	18,136,333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 >	1,916,026,395円
SMAM・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	1,714,171,545円
SMAM・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	6,580,694,503円
SMAM・バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 >	42,196,059円
SMAM・バランスファンドVL50 < 適格機関投資家限定 >	170,114,126円
SMAM・バランスファンドVA75 < 適格機関投資家専用 >	757,184,109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 >	46,145,335円
SMAM・インデックス・バランスVA25 < 適格機関投資家専用 >	273,743,343円
SMAM・インデックス・バランスVA50 < 適格機関投資家専用 >	867,199,080円
SMAM・バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 >	631,383,707円
SMAM・バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 >	1,975,752,149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 >	49,427,347円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A < 適格機関投資家専用 >	34,294,216円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A < 適格機関投資家専用 >	16,660,949円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L < 適格機関投資家専用 >	120,349,891円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 >	260,118,018円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2 < 適格機関投資家専用 >	66,750,857円

SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	40,296,669円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	7,401,642円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	46,604,976円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	636,038,201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>	309,813,284円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	68,313,365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	60,058,250,145円

(2022年9月15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	60,058,250,145円
同期中における追加設定元本額	12,180,948,100円
同期中における一部解約元本額	7,276,586,452円

## 2022年9月15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	9,518,027,852円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	1,024,145,291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)	62,318,872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)	260,505,626円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,389,634,617円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	21,281,199,609円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	131,058,857円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	212,157,060円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	139,804,903円
イオン・バランス戦略ファンド	24,182,335円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	38,184,508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)	358,413,998円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	411,029,732円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	48,938,329円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	754,991,152円

三井住友D S ・年金バランス30 (債券重点型)	39,292,044円
三井住友D S ・年金バランス50 (標準型)	191,390,450円
三井住友D S ・年金バランス70 (株式重点型)	182,254,034円
三井住友D S ・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	1,185,822,718円
三井住友D S ・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)	2,657,529,792円
バランスファンドVA (安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	12,860,629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 >	37,699,412円
SMAM ・アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 >	43,674,328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 >	104,336,158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 >	54,212,383円
SMAM ・アセットバランスファンドVA35A2 < 適格機関投資家専用 >	38,507,732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 >	42,112,383円
SMAM ・アセットバランスファンドVA25L2 < 適格機関投資家専用 >	564,257,278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)	174,943,931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	64,962,611,793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	3,625.000	12,687,500	
日本水産	106,900	543.000	58,046,700	
マルハニチロ	14,800	2,394.000	35,431,200	
雪国まいたけ	10,000	997.000	9,970,000	
カネコ種苗	5,900	1,540.000	9,086,000	
サカタのタネ	12,500	4,920.000	61,500,000	
ホクト	8,500	1,906.000	16,201,000	
日鉄鉱業	2,400	5,960.000	14,304,000	
三井松島ホールディングス	5,200	3,490.000	18,148,000	
I N P E X	365,300	1,536.000	561,100,800	
石油資源開発	13,700	3,820.000	52,334,000	
K & O エナジーグループ	5,200	1,716.000	8,923,200	
ショーボンドホールディングス	13,400	6,220.000	83,348,000	
ミライト・ワン	36,900	1,517.000	55,977,300	
タマホーム	7,100	2,371.000	16,834,100	
Robot Home	19,800	185.000	3,663,000	
安藤・間	52,300	894.000	46,756,200	
東急建設	33,500	673.000	22,545,500	
コムシスホールディングス	36,900	2,574.000	94,980,600	
ピーアールホールディングス	20,400	344.000	7,017,600	
高松コンストラクショングループ	7,400	1,896.000	14,030,400	
東建コーポレーション	3,100	8,590.000	26,629,000	
ヤマウラ	7,600	958.000	7,280,800	
オリエンタル白石	42,200	250.000	10,550,000	
大成建設	73,900	4,215.000	311,488,500	
大林組	245,800	963.000	236,705,400	
清水建設	227,500	759.000	172,672,500	
飛鳥建設	9,700	1,068.000	10,359,600	
長谷工コーポレーション	70,800	1,635.000	115,758,000	
松井建設	9,700	590.000	5,723,000	
銭高組	2,500	3,180.000	7,950,000	
鹿島建設	180,200	1,462.000	263,452,400	
不動テトラ	6,400	1,548.000	9,907,200	
大末建設	3,900	1,541.000	6,009,900	
鉄建建設	7,100	1,787.000	12,687,700	
西松建設	16,500	4,110.000	67,815,000	
三井住友建設	63,500	450.000	28,575,000	
大豊建設	4,100	4,230.000	17,343,000	
奥村組	13,200	2,971.000	39,217,200	
東鉄工業	10,400	2,352.000	24,460,800	
浅沼組	6,400	2,801.000	17,926,400	

戸田建設	101,400	765.000	77,571,000
熊谷組	13,100	2,576.000	33,745,600
北野建設	5,000	2,353.000	11,765,000
矢作建設工業	10,900	764.000	8,327,600
ピーエス三菱	10,100	642.000	6,484,200
日本ハウスホールディングス	17,000	453.000	7,701,000
大東建託	27,200	14,770.000	401,744,000
新日本建設	10,700	716.000	7,661,200
東亜道路工業	1,600	5,940.000	9,504,000
日本道路	2,400	6,070.000	14,568,000
東亜建設工業	6,300	2,416.000	15,220,800
日本国土開発	21,500	615.000	13,222,500
若築建設	4,700	2,200.000	10,340,000
東洋建設	30,600	854.000	26,132,400
五洋建設	99,200	725.000	71,920,000
世紀東急工業	13,200	765.000	10,098,000
福田組	2,600	4,840.000	12,584,000
住友林業	52,800	2,315.000	122,232,000
日本基礎技術	13,100	492.000	6,445,200
巴コーポレーション	19,300	410.000	7,913,000
大和ハウス工業	210,100	3,094.000	650,049,400
ライト工業	13,800	1,929.000	26,620,200
積水ハウス	252,000	2,486.000	626,472,000
日特建設	6,800	941.000	6,398,800
北陸電気工事	1,100	738.000	811,800
ユアテック	14,700	733.000	10,775,100
日本リーテック	5,800	810.000	4,698,000
中電工	8,500	2,144.000	18,224,000
関電工	39,600	846.000	33,501,600
きんでん	52,000	1,524.000	79,248,000
東京エネシス	8,500	1,007.000	8,559,500
トーエネック	2,800	3,460.000	9,688,000
住友電設	6,200	2,654.000	16,454,800
日本電設工業	10,400	1,797.000	18,688,800
エクシオグループ	36,500	2,159.000	78,803,500
新日本空調	5,900	1,869.000	11,027,100
九電工	17,000	2,884.000	49,028,000
三機工業	16,900	1,687.000	28,510,300
日揮ホールディングス	75,400	1,981.000	149,367,400
中外炉工業	3,600	1,597.000	5,749,200
ヤマト	11,900	777.000	9,246,300
太平電業	4,900	3,480.000	17,052,000
高砂熱学工業	19,800	1,635.000	32,373,000
朝日工業社	3,600	1,839.000	6,620,400
明星工業	14,400	728.000	10,483,200
大気社	10,900	3,240.000	35,316,000
ダイダン	5,100	2,242.000	11,434,200
日比谷総合設備	7,200	1,873.000	13,485,600

テスホールディングス	8,200	1,089.000	8,929,800
インフロニア・ホールディングス	92,500	1,009.000	93,332,500
東洋エンジニアリング	12,500	647.000	8,087,500
レイズネクスト	10,800	1,175.000	12,690,000
ニッポン	19,900	1,545.000	30,745,500
日清製粉グループ本社	79,700	1,456.000	116,043,200
日東富士製粉	600	4,600.000	2,760,000
昭和産業	6,400	2,480.000	15,872,000
中部飼料	8,800	1,065.000	9,372,000
フィード・ワン	10,300	691.000	7,117,300
日本甜菜製糖	5,200	1,610.000	8,372,000
D M三井製糖ホールディングス	6,500	1,860.000	12,090,000
日新製糖	4,000	1,754.000	7,016,000
森永製菓	17,300	3,835.000	66,345,500
中村屋	2,800	3,100.000	8,680,000
江崎グリコ	19,900	3,475.000	69,152,500
名糖産業	3,600	1,630.000	5,868,000
井村屋グループ	4,400	2,232.000	9,820,800
不二家	4,600	2,384.000	10,966,400
山崎製パン	46,900	1,602.000	75,133,800
モロゾフ	2,900	3,635.000	10,541,500
亀田製菓	4,400	4,405.000	19,382,000
寿スピリッツ	7,400	8,320.000	61,568,000
カルビー	39,100	2,931.000	114,602,100
森永乳業	14,600	4,050.000	59,130,000
六甲バター	5,300	1,419.000	7,520,700
ヤクルト本社	54,000	8,160.000	440,640,000
明治ホールディングス	46,800	6,320.000	295,776,000
雪印メグミルク	18,800	1,665.000	31,302,000
プリマハム	10,400	2,076.000	21,590,400
日本ハム	29,900	3,900.000	116,610,000
丸大食品	8,500	1,496.000	12,716,000
S Foods	7,600	2,939.000	22,336,400
柿安本店	3,100	2,269.000	7,033,900
伊藤ハム米久ホールディングス	48,700	660.000	32,142,000
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	4,658.000	745,745,800
キリンホールディングス	312,900	2,203.000	689,318,700
宝ホールディングス	47,000	1,064.000	50,008,000
オエノンホールディングス	23,700	286.000	6,778,200
養命酒製造	1,400	1,814.000	2,539,600
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	54,400	1,421.000	77,302,400
サントリー食品インターナショナル	48,600	5,060.000	245,916,000
ダイドーグループホールディングス	4,300	4,665.000	20,059,500
伊藤園	25,800	5,880.000	151,704,000
キーコーヒー	7,900	2,086.000	16,479,400
日清オイリオグループ	9,500	3,185.000	30,257,500

不二製油グループ本社	18,800	2,371.000	44,574,800
かどや製油	3,100	3,555.000	11,020,500
J - オイルミルズ	8,000	1,553.000	12,424,000
キッコーマン	50,800	8,410.000	427,228,000
味の素	169,800	4,005.000	680,049,000
ブルドックソース	3,500	1,835.000	6,422,500
キューピー	37,200	2,222.000	82,658,400
ハウス食品グループ本社	26,300	2,916.000	76,690,800
カゴメ	32,300	2,965.000	95,769,500
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	4,660.000	35,882,000
ニチレイ	32,200	2,386.000	76,829,200
東洋水産	38,000	5,650.000	214,700,000
イトアンドホールディングス	4,000	2,181.000	8,724,000
日清食品ホールディングス	27,400	9,780.000	267,972,000
永谷園ホールディングス	4,300	1,985.000	8,535,500
フジッコ	7,900	1,892.000	14,946,800
ロック・フィールド	8,700	1,493.000	12,989,100
日本たばこ産業	456,100	2,361.500	1,077,080,150
ケンコーマヨネーズ	4,900	1,527.000	7,482,300
わらべや日洋ホールディングス	5,500	2,213.000	12,171,500
なとり	5,300	2,030.000	10,759,000
ファーマフーズ	10,900	1,308.000	14,257,200
ユーグレナ	46,100	941.000	43,380,100
紀文食品	7,700	991.000	7,630,700
ピクルスホールディングス	5,000	1,054.000	5,270,000
ミヨシ油脂	1,300	998.000	1,297,400
理研ビタミン	6,300	1,705.000	10,741,500
片倉工業	8,500	1,996.000	16,966,000
グンゼ	4,900	3,865.000	18,938,500
東洋紡	35,000	1,103.000	38,605,000
ユニチカ	32,200	274.000	8,822,800
富士紡ホールディングス	3,700	3,405.000	12,598,500
倉敷紡績	6,400	2,133.000	13,651,200
シキボウ	8,600	896.000	7,705,600
日本毛織	20,800	1,076.000	22,380,800
帝国繊維	8,300	1,604.000	13,313,200
帝人	73,900	1,463.000	108,115,700
東レ	516,600	778.700	402,276,420
アツギ	15,000	398.000	5,970,000
ダイニック	3,300	610.000	2,013,000
セーレン	15,400	2,075.000	31,955,000
小松マテーレ	13,100	821.000	10,755,100
ワコールホールディングス	17,300	2,253.000	38,976,900
ホギメディカル	10,500	3,410.000	35,805,000
T S Iホールディングス	28,600	429.000	12,269,400
ワールド	11,600	1,416.000	16,425,600
三陽商会	5,400	985.000	5,319,000

オンワードホールディングス	52,100	300.000	15,630,000
ゴールドウイン	13,700	7,980.000	109,326,000
デサント	14,200	3,605.000	51,191,000
特種東海製紙	4,800	3,060.000	14,688,000
王子ホールディングス	319,900	546.000	174,665,400
日本製紙	34,100	872.000	29,735,200
北越コーポレーション	50,000	750.000	37,500,000
大王製紙	35,900	1,208.000	43,367,200
レンゴー	65,900	837.000	55,158,300
トーモク	5,100	1,516.000	7,731,600
ザ・バック	5,600	2,282.000	12,779,200
北の達人コーポレーション	33,100	251.000	8,308,100
クラレ	112,300	1,065.000	119,599,500
旭化成	512,400	1,014.500	519,829,800
昭和電工	68,200	2,117.000	144,379,400
住友化学	564,100	542.000	305,742,200
住友精化	3,500	3,350.000	11,725,000
日産化学	37,300	6,890.000	256,997,000
ラサ工業	3,500	2,393.000	8,375,500
クレハ	5,900	9,210.000	54,339,000
多木化学	2,800	4,975.000	13,930,000
テイカ	4,900	1,279.000	6,267,100
石原産業	15,200	1,061.000	16,127,200
日本曹達	9,100	4,490.000	40,859,000
東ソー	102,100	1,756.000	179,287,600
トクヤマ	25,200	1,845.000	46,494,000
セントラル硝子	12,500	3,445.000	43,062,500
東亜合成	35,600	1,107.000	39,409,200
大阪ソーダ	6,300	3,840.000	24,192,000
関東電化工業	16,100	999.000	16,083,900
デンカ	28,000	3,340.000	93,520,000
信越化学工業	131,500	16,185.000	2,128,327,500
日本カーバイド工業	4,300	1,290.000	5,547,000
堺化学工業	5,700	1,948.000	11,103,600
第一稀元素化学工業	7,900	1,340.000	10,586,000
エア・ウォーター	66,300	1,718.000	113,903,400
日本酸素ホールディングス	67,700	2,494.000	168,843,800
日本化学工業	3,000	2,003.000	6,009,000
日本パーカライジング	33,500	961.000	32,193,500
高圧ガス工業	12,200	659.000	8,039,800
四国化成工業	9,300	1,279.000	11,894,700
ステラ ケミファ	4,500	2,704.000	12,168,000
保土谷化学工業	2,500	3,210.000	8,025,000
日本触媒	11,700	5,700.000	66,690,000
大日精化工業	6,100	1,766.000	10,772,600
カネカ	17,600	3,900.000	68,640,000
三菱瓦斯化学	65,000	2,074.000	134,810,000
三井化学	64,200	3,080.000	197,736,000



J S R	77,300	3,095.000	239,243,500
東京応化工業	12,400	6,580.000	81,592,000
大阪有機化学工業	5,400	2,257.000	12,187,800
三菱ケミカルグループ	516,300	718.800	371,116,440
K H ネオケム	11,700	2,596.000	30,373,200
ダイセル	111,900	899.000	100,598,100
住友ベークライト	11,700	4,315.000	50,485,500
積水化学工業	157,300	1,846.000	290,375,800
日本ゼオン	62,100	1,397.000	86,753,700
アイカ工業	19,600	3,190.000	62,524,000
U B E	39,100	2,048.000	80,076,800
積水樹脂	10,900	1,704.000	18,573,600
タキロンシーアイ	17,700	534.000	9,451,800
旭有機材	4,900	2,326.000	11,397,400
ニチバン	4,900	1,641.000	8,040,900
リケンテクノス	16,700	530.000	8,851,000
大倉工業	3,700	1,773.000	6,560,100
積水化成成品工業	9,000	411.000	3,699,000
群栄化学工業	2,000	2,427.000	4,854,000
ミライアル	4,100	1,909.000	7,826,900
ダイキョーニシカワ	17,800	585.000	10,413,000
森六ホールディングス	4,500	1,781.000	8,014,500
恵和	2,400	4,185.000	10,044,000
日本化薬	57,400	1,214.000	69,683,600
カーリットホールディングス	8,800	663.000	5,834,400
日本精化	5,500	1,950.000	10,725,000
扶桑化学工業	6,300	3,425.000	21,577,500
トリケミカル研究所	8,700	2,277.000	19,809,900
A D E K A	32,200	2,283.000	73,512,600
日油	23,800	5,160.000	122,808,000
ハリマ化成グループ	7,500	920.000	6,900,000
花王	175,200	6,058.000	1,061,361,600
第一工業製薬	3,300	2,133.000	7,038,900
石原ケミカル	4,600	1,294.000	5,952,400
ニイタカ	2,100	2,295.000	4,819,500
三洋化成工業	4,600	4,575.000	21,045,000
大日本塗料	12,400	729.000	9,039,600
日本ペイントホールディングス	311,600	1,105.000	344,318,000
関西ペイント	72,000	2,146.000	154,512,000
中国塗料	18,900	869.000	16,424,100
日本特殊塗料	5,600	956.000	5,353,600
藤倉化成	12,000	449.000	5,388,000
太陽ホールディングス	12,100	2,671.000	32,319,100
D I C	27,800	2,533.000	70,417,400
サカタインクス	15,400	978.000	15,061,200
東洋インキS Cホールディングス	13,200	1,905.000	25,146,000
T & K T O K A	7,600	994.000	7,554,400
富士フイルムホールディングス	148,900	6,975.000	1,038,577,500

資生堂	147,500	5,152.000	759,920,000
ライオン	85,600	1,618.000	138,500,800
高砂香料工業	4,800	2,708.000	12,998,400
マンダム	17,100	1,522.000	26,026,200
ミルボン	10,600	6,390.000	67,734,000
ファンケル	34,400	2,854.000	98,177,600
コーセー	14,400	14,590.000	210,096,000
コタ	6,100	1,547.000	9,436,700
ポーラ・オルビスホールディングス	36,400	1,609.000	58,567,600
ノエビアホールディングス	6,300	5,750.000	36,225,000
新日本製薬	4,600	1,604.000	7,378,400
エステー	6,300	1,525.000	9,607,500
コニシ	12,600	1,632.000	20,563,200
長谷川香料	14,500	3,035.000	44,007,500
小林製薬	21,600	8,310.000	179,496,000
荒川化学工業	6,900	1,036.000	7,148,400
メック	5,900	2,376.000	14,018,400
日本高純度化学	2,500	2,353.000	5,882,500
タカラバイオ	22,200	1,835.000	40,737,000
J C U	8,500	3,165.000	26,902,500
デクセリアルズ	22,100	4,035.000	89,173,500
アース製薬	6,500	5,330.000	34,645,000
北興化学工業	10,200	963.000	9,822,600
大成ラミック	5,200	2,900.000	15,080,000
クミアイ化学工業	28,400	1,009.000	28,655,600
日本農薬	16,100	854.000	13,749,400
アキレス	6,500	1,327.000	8,625,500
有沢製作所	12,600	1,339.000	16,871,400
日東電工	51,000	9,000.000	459,000,000
レック	11,600	800.000	9,280,000
三光合成	12,500	489.000	6,112,500
きもと	35,300	255.000	9,001,500
藤森工業	6,300	3,430.000	21,609,000
前澤化成工業	6,800	1,306.000	8,880,800
未来工業	3,400	1,496.000	5,086,400
J S P	5,400	1,444.000	7,797,600
エフピコ	15,900	3,330.000	52,947,000
天馬	6,500	2,102.000	13,663,000
信越ポリマー	14,700	1,289.000	18,948,300
東リ	29,100	201.000	5,849,100
ニフコ	28,200	3,085.000	86,997,000
バルカー	7,100	2,671.000	18,964,100
ユニ・チャーム	147,200	4,778.000	703,321,600
協和キリン	84,800	3,210.000	272,208,000
武田薬品工業	666,100	3,876.000	2,581,803,600
アステラス製薬	724,500	1,989.500	1,441,392,750
住友ファーマ	52,600	1,033.000	54,335,800
塩野義製薬	98,500	7,010.000	690,485,000

わかもと製薬	9,000	235.000	2,115,000
日本新薬	18,500	7,470.000	138,195,000
中外製薬	220,600	3,565.000	786,439,000
科研製薬	12,300	3,850.000	47,355,000
エーザイ	93,800	5,943.000	557,453,400
ロート製薬	40,400	4,375.000	176,750,000
小野薬品工業	163,400	3,330.000	544,122,000
久光製薬	17,800	3,410.000	60,698,000
持田製薬	9,500	3,345.000	31,777,500
参天製薬	148,100	986.000	146,026,600
扶桑薬品工業	3,400	1,991.000	6,769,400
ツムラ	24,200	3,010.000	72,842,000
キッセイ薬品工業	12,000	2,504.000	30,048,000
生化学工業	15,200	876.000	13,315,200
栄研化学	13,000	1,809.000	23,517,000
鳥居薬品	3,600	2,808.000	10,108,800
JCRファーマ	24,100	2,147.000	51,742,700
東和薬品	12,200	2,143.000	26,144,600
富士製薬工業	6,300	1,007.000	6,344,100
ゼリア新薬工業	12,800	2,038.000	26,086,400
第一三共	614,600	4,253.000	2,613,893,800
キョーリン製薬ホールディングス	15,400	1,745.000	26,873,000
大幸薬品	15,300	607.000	9,287,100
ダイト	5,600	2,658.000	14,884,800
大塚ホールディングス	161,300	4,532.000	731,011,600
大正製薬ホールディングス	16,700	5,160.000	86,172,000
ペプチドリーム	34,700	1,688.000	58,573,600
あすか製薬ホールディングス	8,700	1,145.000	9,961,500
サワイグループホールディングス	16,300	4,015.000	65,444,500
日本コークス工業	80,300	97.000	7,789,100
ニチレキ	9,100	1,306.000	11,884,600
ユシロ化学工業	11,700	870.000	10,179,000
富士石油	24,400	334.000	8,149,600
出光興産	85,900	3,455.000	296,784,500
E N E O Sホールディングス	1,274,500	510.100	650,122,450
コスモエネルギーホールディングス	33,500	3,970.000	132,995,000
横浜ゴム	39,900	2,307.000	92,049,300
TOYO TIRE	40,600	1,667.000	67,680,200
ブリヂストン	225,200	5,090.000	1,146,268,000
住友ゴム工業	69,400	1,231.000	85,431,400
藤倉コンポジット	7,900	929.000	7,339,100
オカモト	4,100	3,790.000	15,539,000
フコク	3,500	998.000	3,493,000
ニッタ	7,600	2,925.000	22,230,000
住友理工	16,400	578.000	9,479,200
三ツ星ベルト	10,400	3,330.000	34,632,000
バンドー化学	13,600	1,034.000	14,062,400
日東紡績	10,900	2,468.000	26,901,200

AGC	71,800	4,785.000	343,563,000
日本電気硝子	29,200	2,638.000	77,029,600
オハラ	6,000	1,454.000	8,724,000
住友大阪セメント	13,300	3,470.000	46,151,000
太平洋セメント	48,700	2,124.000	103,438,800
日本ヒューム	9,700	656.000	6,363,200
日本コンクリート工業	23,800	269.000	6,402,200
三谷セキサン	4,200	3,775.000	15,855,000
アジアパイルホールディングス	16,100	510.000	8,211,000
東海カーボン	59,900	1,015.000	60,798,500
日本カーボン	4,300	4,070.000	17,501,000
東洋炭素	4,600	3,375.000	15,525,000
ノリタケカンパニーリミテド	4,300	4,070.000	17,501,000
TOTO	51,100	4,850.000	247,835,000
日本碍子	83,000	1,986.000	164,838,000
日本特殊陶業	59,300	2,928.000	173,630,400
MARUWA	2,900	17,340.000	50,286,000
品川リフラクトリーズ	2,200	3,980.000	8,756,000
黒崎播磨	1,700	4,965.000	8,440,500
ヨータイ	5,200	1,400.000	7,280,000
東京窯業	27,100	268.000	7,262,800
フジインコーポレーテッド	6,800	6,290.000	42,772,000
ニチアス	17,500	2,351.000	41,142,500
ニチハ	10,700	2,846.000	30,452,200
日本製鉄	349,800	2,253.000	788,099,400
神戸製鋼所	145,900	640.000	93,376,000
中山製鋼所	14,100	614.000	8,657,400
合同製鉄	4,700	1,827.000	8,586,900
JFEホールディングス	193,200	1,469.000	283,810,800
東京製鉄	24,400	1,309.000	31,939,600
共英製鋼	8,000	1,520.000	12,160,000
大和工業	13,400	4,575.000	61,305,000
東京製鋼	4,400	1,325.000	5,830,000
大阪製鉄	7,100	1,204.000	8,548,400
淀川製鋼所	8,400	2,479.000	20,823,600
丸一鋼管	23,900	2,905.000	69,429,500
モリ工業	3,900	2,697.000	10,518,300
大同特殊鋼	11,300	3,755.000	42,431,500
日本冶金工業	6,300	2,837.000	17,873,100
山陽特殊製鋼	7,000	2,026.000	14,182,000
愛知製鋼	5,000	2,137.000	10,685,000
日立金属	89,900	2,162.000	194,363,800
大平洋金属	5,500	2,388.000	13,134,000
新日本電工	48,400	358.000	17,327,200
栗本鐵工所	3,900	1,625.000	6,337,500
三菱製鋼	7,000	999.000	6,993,000
日本精線	1,500	4,620.000	6,930,000
新家工業	6,200	1,667.000	10,335,400

大紀アルミニウム工業所	10,600	1,340.000	14,204,000
日本軽金属ホールディングス	21,900	1,609.000	35,237,100
三井金属鉱業	22,700	3,170.000	71,959,000
東邦亜鉛	4,900	2,453.000	12,019,700
三菱マテリアル	48,900	2,033.000	99,413,700
住友金属鉱山	92,000	4,419.000	406,548,000
DOWAホールディングス	19,500	5,450.000	106,275,000
古河機械金属	12,200	1,250.000	15,250,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	10,000	3,415.000	34,150,000
東邦チタニウム	15,200	2,630.000	39,976,000
UACJ	11,300	2,416.000	27,300,800
CKサンエツ	1,600	4,005.000	6,408,000
古河電気工業	24,500	2,479.000	60,735,500
住友電気工業	291,700	1,610.000	469,637,000
フジクラ	93,500	962.000	89,947,000
昭和電線ホールディングス	7,600	1,872.000	14,227,200
タツタ電線	14,900	455.000	6,779,500
平河ヒューテック	4,900	1,095.000	5,365,500
リョービ	8,500	1,311.000	11,143,500
アーレスティ	12,000	405.000	4,860,000
アサヒホールディングス	33,700	2,111.000	71,140,700
稲葉製作所	10,400	1,343.000	13,967,200
宮地エンジニアリンググループ	2,700	3,235.000	8,734,500
トーカロ	21,100	1,252.000	26,417,200
アルファ	8,800	935.000	8,228,000
SUMCO	138,400	1,923.000	266,143,200
川田テクノロジーズ	1,900	3,765.000	7,153,500
RS TECHNOLOGIES	2,400	6,670.000	16,008,000
信和	17,600	808.000	14,220,800
東洋製罐グループホールディングス	42,800	1,786.000	76,440,800
ホッカンホールディングス	5,800	1,324.000	7,679,200
横河ブリッジホールディングス	11,700	1,958.000	22,908,600
三和ホールディングス	78,500	1,355.000	106,367,500
文化シャッター	24,300	1,061.000	25,782,300
三協立山	11,100	604.000	6,704,400
アルインコ	7,500	905.000	6,787,500
LIXIL	131,600	2,298.000	302,416,800
ノーリツ	10,800	1,539.000	16,621,200
長府製作所	7,200	2,013.000	14,493,600
リンナイ	14,500	10,420.000	151,090,000
日東精工	11,200	529.000	5,924,800
岡部	13,500	667.000	9,004,500
ジーテクト	8,300	1,378.000	11,437,400
東プレ	12,300	1,244.000	15,301,200
高周波熱錬	14,300	682.000	9,752,600
東京製綱	6,100	960.000	5,856,000
サンコール	8,800	748.000	6,582,400
パイオラックス	11,000	1,958.000	21,538,000

エイチワン	1,400	598.000	837,200
日本発条	70,100	943.000	66,104,300
三益半導体工業	6,300	2,065.000	13,009,500
日本製鋼所	21,700	3,045.000	66,076,500
三浦工業	33,100	2,847.000	94,235,700
タクマ	24,400	1,300.000	31,720,000
ツガミ	17,500	1,196.000	20,930,000
オークマ	8,000	5,120.000	40,960,000
芝浦機械	9,700	2,896.000	28,091,200
アマダ	131,000	1,079.000	141,349,000
アイダエンジニアリング	18,100	829.000	15,004,900
F U J I	33,300	1,994.000	66,400,200
牧野フライス製作所	8,500	4,435.000	37,697,500
オーエスジー	34,200	1,869.000	63,919,800
旭ダイヤモンド工業	21,500	758.000	16,297,000
D M G 森精機	43,300	1,733.000	75,038,900
ソディック	21,300	793.000	16,890,900
ディスコ	12,400	34,600.000	429,040,000
日東工器	4,600	1,616.000	7,433,600
日進工具	6,600	1,111.000	7,332,600
パンチ工業	10,300	435.000	4,480,500
豊和工業	6,800	814.000	5,535,200
東洋機械金属	8,000	573.000	4,584,000
島精機製作所	12,100	2,137.000	25,857,700
オプトラン	10,900	2,358.000	25,702,200
N C ホールディングス	3,300	1,879.000	6,200,700
イワキ	6,400	1,393.000	8,915,200
フリーー	8,600	1,018.000	8,754,800
ヤマシンフィルタ	17,000	329.000	5,593,000
日阪製作所	9,700	836.000	8,109,200
やまびこ	12,200	1,149.000	14,017,800
野村マイクロ・サイエンス	2,800	3,760.000	10,528,000
平田機工	3,800	4,450.000	16,910,000
ベガサスミシン製造	10,400	931.000	9,682,400
マルマエ	4,200	2,038.000	8,559,600
タツモ	5,200	1,407.000	7,316,400
ナブテスコ	44,800	3,145.000	140,896,000
レオン自動機	9,400	1,204.000	11,317,600
S M C	24,800	65,620.000	1,627,376,000
ホソカワミクロン	5,500	2,543.000	13,986,500
ユニオンツール	3,000	3,510.000	10,530,000
オイレス工業	11,000	1,504.000	16,544,000
日精エー・エス・ビー機械	3,400	4,100.000	13,940,000
サトーホールディングス	11,200	1,900.000	21,280,000
技研製作所	7,500	3,415.000	25,612,500
日本エアテック	5,500	1,063.000	5,846,500
日精樹脂工業	6,800	945.000	6,426,000
オカダアイヨン	4,100	1,454.000	5,961,400

ワイエイシイホールディングス	4,100	1,396.000	5,723,600
小松製作所	384,100	2,836.000	1,089,307,600
住友重機械工業	45,100	2,897.000	130,654,700
日立建機	33,900	2,893.000	98,072,700
日工	13,300	635.000	8,445,500
巴工業	3,600	2,470.000	8,892,000
井関農機	8,200	1,228.000	10,069,600
T O W A	7,700	1,845.000	14,206,500
ローツェ	4,200	8,300.000	34,860,000
クボタ	379,000	2,160.000	818,640,000
荏原実業	3,700	2,197.000	8,128,900
三菱化工機	3,400	2,207.000	7,503,800
月島機械	14,500	900.000	13,050,000
帝国電機製作所	5,800	1,935.000	11,223,000
新東工業	16,900	706.000	11,931,400
澁谷工業	6,600	2,436.000	16,077,600
アイチコーポレーション	12,300	810.000	9,963,000
小森コーポレーション	20,200	741.000	14,968,200
鶴見製作所	6,400	2,249.000	14,393,600
住友精密工業	2,900	2,624.000	7,609,600
酒井重工業	2,100	2,998.000	6,295,800
荏原製作所	29,000	5,180.000	150,220,000
西島製作所	8,400	1,351.000	11,348,400
北越工業	8,200	1,009.000	8,273,800
ダイキン工業	92,500	24,240.000	2,242,200,000
オルガノ	2,400	8,750.000	21,000,000
トーヨーカネツ	3,600	2,507.000	9,025,200
栗田工業	42,700	5,410.000	231,007,000
椿本チエイン	10,800	3,265.000	35,262,000
大同工業	9,900	735.000	7,276,500
木村化工機	10,300	734.000	7,560,200
アネスト岩田	13,900	923.000	12,829,700
ダイフク	39,900	7,450.000	297,255,000
サムコ	2,600	3,330.000	8,658,000
タダノ	41,500	905.000	37,557,500
フジテック	26,100	2,900.000	75,690,000
C K D	21,400	1,860.000	39,804,000
平和	24,100	2,134.000	51,429,400
理想科学工業	7,300	2,420.000	17,666,000
S A N K Y O	17,800	3,980.000	70,844,000
日本金銭機械	10,500	658.000	6,909,000
マースグループホールディングス	6,200	1,645.000	10,199,000
フクシマガリレイ	5,200	3,620.000	18,824,000
ダイコク電機	5,200	1,311.000	6,817,200
竹内製作所	13,000	2,699.000	35,087,000
アマノ	22,400	2,516.000	56,358,400
J U K I	13,200	703.000	9,279,600
ジャノメ	8,800	679.000	5,975,200

マックス	10,000	1,997.000	19,970,000
グローリー	20,800	2,236.000	46,508,800
新晃工業	8,200	1,555.000	12,751,000
大和冷機工業	12,000	1,085.000	13,020,000
セガサミーホールディングス	76,400	1,958.000	149,591,200
日本ピストンリング	5,200	1,263.000	6,567,600
リケン	3,800	2,400.000	9,120,000
T P R	9,900	1,284.000	12,711,600
ツバキ・ナカシマ	18,700	1,177.000	22,009,900
ホシザキ	45,700	3,915.000	178,915,500
大豊工業	8,300	702.000	5,826,600
日本精工	145,300	773.000	112,316,900
N T N	158,500	281.000	44,538,500
ジェイテクト	71,500	1,005.000	71,857,500
不二越	6,100	3,705.000	22,600,500
日本トムソン	21,200	580.000	12,296,000
T H K	41,100	2,644.000	108,668,400
前澤給装工業	6,600	894.000	5,900,400
イーグル工業	9,900	1,202.000	11,899,800
日本ピラー工業	7,400	2,536.000	18,766,400
キッツ	27,700	800.000	22,160,000
マキタ	95,900	3,078.000	295,180,200
日立造船	67,900	879.000	59,684,100
三菱重工業	124,500	5,228.000	650,886,000
I H I	53,000	3,620.000	191,860,000
スター精密	14,000	1,775.000	24,850,000
日清紡ホールディングス	58,800	1,075.000	63,210,000
イビデン	40,800	4,530.000	184,824,000
コニカミノルタ	171,500	491.000	84,206,500
ブラザー工業	96,100	2,593.000	249,187,300
ミネベアミツミ	134,300	2,405.000	322,991,500
日立製作所	407,500	6,828.000	2,782,410,000
東芝	148,300	4,981.000	738,682,300
三菱電機	790,200	1,357.500	1,072,696,500
富士電機	47,000	5,910.000	277,770,000
安川電機	84,100	4,555.000	383,075,500
シンフォニア テクノロジー	9,500	1,440.000	13,680,000
明電舎	12,300	2,001.000	24,612,300
オリジン	1,500	1,428.000	2,142,000
山洋電気	3,200	5,210.000	16,672,000
デンヨー	6,600	1,507.000	9,946,200
P H C ホールディングス	13,400	1,552.000	20,796,800
東芝テック	9,100	4,055.000	36,900,500
芝浦メカトロニクス	1,500	10,890.000	16,335,000
マブチモーター	17,600	4,010.000	70,576,000
日本電産	188,300	9,236.000	1,739,138,800
トレックス・セミコンダクター	4,000	2,834.000	11,336,000
東光高岳	5,300	1,904.000	10,091,200



ダブル・スコープ	23,600	2,979.000	70,304,400
ダイヘン	7,900	3,975.000	31,402,500
ヤーマン	14,300	1,316.000	18,818,800
JVCケンウッド	79,900	202.000	16,139,800
ミマキエンジニアリング	9,500	710.000	6,745,000
I - P E X	5,200	1,344.000	6,988,800
日新電機	19,300	1,371.000	26,460,300
大崎電気工業	18,300	533.000	9,753,900
オムロン	70,600	6,986.000	493,211,600
日東工業	10,700	2,623.000	28,066,100
I D E C	10,600	2,914.000	30,888,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	25,700	2,491.000	64,018,700
メルコホールディングス	2,500	3,215.000	8,037,500
日本電気	100,400	5,020.000	504,008,000
富士通	76,200	16,295.000	1,241,679,000
沖電気工業	34,300	732.000	25,107,600
電気興業	4,400	2,355.000	10,362,000
サンケン電気	7,300	4,850.000	35,405,000
アイホン	4,500	2,054.000	9,243,000
ルネサスエレクトロニクス	462,300	1,321.000	610,698,300
セイコーエプソン	94,600	2,147.000	203,106,200
ワコム	64,900	781.000	50,686,900
アルバック	17,000	5,800.000	98,600,000
アクセル	6,500	953.000	6,194,500
E I Z O	5,900	3,830.000	22,597,000
日本信号	18,100	931.000	16,851,100
京三製作所	18,800	428.000	8,046,400
能美防災	9,400	1,598.000	15,021,200
ホーチキ	5,900	1,342.000	7,917,800
エレコム	19,600	1,589.000	31,144,400
パナソニック ホールディングス	903,600	1,130.000	1,021,068,000
シャープ	80,800	951.000	76,840,800
アンリツ	54,600	1,632.000	89,107,200
富士通ゼネラル	23,200	2,917.000	67,674,400
ソニーグループ	530,800	10,470.000	5,557,476,000
T D K	122,600	5,100.000	625,260,000
帝国通信工業	4,600	1,449.000	6,665,400
タムラ製作所	32,200	692.000	22,282,400
アルプスアルパイン	69,100	1,239.000	85,614,900
日本電波工業	9,500	1,519.000	14,430,500
鈴木	3,000	875.000	2,625,000
メイコー	9,300	2,957.000	27,500,100
日本トリム	2,300	2,330.000	5,359,000
ローランド ディー . ジー .	4,100	3,255.000	13,345,500
フォスター電機	10,400	804.000	8,361,600
S M K	2,600	2,431.000	6,320,600
ヨコオ	6,100	2,167.000	13,218,700
ホシデン	19,000	1,620.000	30,780,000

ヒロセ電機	11,700	20,470.000	239,499,000
日本航空電子工業	16,800	2,393.000	40,202,400
TOA	10,300	790.000	8,137,000
マクセル	16,000	1,455.000	23,280,000
古野電気	10,700	1,129.000	12,080,300
スミダコーポレーション	7,800	1,070.000	8,346,000
アイコム	3,000	2,563.000	7,689,000
リオン	3,200	2,068.000	6,617,600
横河電機	77,800	2,398.000	186,564,400
新電元工業	3,300	3,920.000	12,936,000
アズビル	49,100	4,010.000	196,891,000
東亜ディーケーケー	9,100	849.000	7,725,900
日本光電工業	32,700	3,015.000	98,590,500
チノー	3,900	1,643.000	6,407,700
共和電業	4,200	333.000	1,398,600
日本電子材料	6,100	1,525.000	9,302,500
堀場製作所	15,700	6,220.000	97,654,000
アドバンテスト	62,900	7,610.000	478,669,000
エスベック	6,800	1,814.000	12,335,200
キーエンス	76,800	52,060.000	3,998,208,000
日置電機	3,700	6,650.000	24,605,000
シスメックス	60,800	8,075.000	490,960,000
日本マイクロニクス	12,200	1,393.000	16,994,600
メガチップス	7,700	2,647.000	20,381,900
OBARA GROUP	5,200	3,355.000	17,446,000
コーセル	10,400	926.000	9,630,400
イリソ電子工業	7,300	4,150.000	30,295,000
オブテックスグループ	13,100	2,114.000	27,693,400
千代田インテグレ	5,200	2,209.000	11,486,800
レーザーテック	34,800	18,380.000	639,624,000
スタンレー電気	54,500	2,542.000	138,539,000
岩崎電気	3,300	2,545.000	8,398,500
ウシオ電機	40,200	1,650.000	66,330,000
エノモト	2,500	1,522.000	3,805,000
日本セラミック	7,400	2,660.000	19,684,000
遠藤照明	6,100	769.000	4,690,900
古河電池	6,300	1,173.000	7,389,900
双信電機	8,800	426.000	3,748,800
山一電機	6,400	2,024.000	12,953,600
図研	5,600	3,670.000	20,552,000
日本電子	16,200	5,550.000	89,910,000
カシオ計算機	52,400	1,311.000	68,696,400
ファナック	74,400	21,920.000	1,630,848,000
日本シイエムケイ	18,200	468.000	8,517,600
エンプラス	2,300	4,420.000	10,166,000
大真空	11,700	962.000	11,255,400
ローム	35,200	10,730.000	377,696,000
浜松ホトニクス	56,200	6,300.000	354,060,000

三井ハイテック	7,300	8,200.000	59,860,000
新光電気工業	24,900	3,755.000	93,499,500
京セラ	119,100	8,025.000	955,777,500
太陽誘電	37,700	4,230.000	159,471,000
村田製作所	231,100	7,460.000	1,724,006,000
双葉電子工業	17,100	649.000	11,097,900
北陸電気工業	4,800	1,097.000	5,265,600
ニチコン	22,900	1,479.000	33,869,100
日本ケミコン	7,300	1,945.000	14,198,500
K O A	12,100	2,478.000	29,983,800
市光工業	12,400	393.000	4,873,200
小糸製作所	41,900	4,665.000	195,463,500
ミツバ	14,800	414.000	6,127,200
S C R E E Nホールディングス	13,400	9,210.000	123,414,000
キャノン電子	8,200	1,625.000	13,325,000
キャノン	386,100	3,310.000	1,277,991,000
リコー	202,000	1,118.000	225,836,000
象印マホービン	20,800	1,615.000	33,592,000
東京エレクトロン	53,800	42,760.000	2,300,488,000
トヨタ紡織	29,500	1,973.000	58,203,500
ユニプレス	15,600	976.000	15,225,600
豊田自動織機	59,700	7,490.000	447,153,000
モリタホールディングス	14,200	1,298.000	18,431,600
三櫻工業	12,800	748.000	9,574,400
デンソー	165,700	7,325.000	1,213,752,500
東海理化電機製作所	21,600	1,493.000	32,248,800
川崎重工業	57,800	2,535.000	146,523,000
日本車輛製造	3,500	2,104.000	7,364,000
三菱ロジスネクスト	14,200	809.000	11,487,800
日産自動車	1,000,700	546.400	546,782,480
いすゞ自動車	244,900	1,787.000	437,636,300
トヨタ自動車	3,862,800	2,040.000	7,880,112,000
日野自動車	106,800	644.000	68,779,200
三菱自動車工業	315,400	615.000	193,971,000
エフテック	8,400	525.000	4,410,000
武蔵精密工業	19,000	1,645.000	31,255,000
日産車体	12,700	807.000	10,248,900
新明和工業	23,200	1,050.000	24,360,000
極東開発工業	13,700	1,367.000	18,727,900
トピー工業	7,300	1,405.000	10,256,500
ティラド	2,900	2,701.000	7,832,900
曙ブレーキ工業	57,900	174.000	10,074,600
タチエス	15,000	1,212.000	18,180,000
N O K	32,300	1,245.000	40,213,500
フタバ産業	21,300	346.000	7,369,800
K Y B	7,600	3,435.000	26,106,000
大同メタル工業	20,800	513.000	10,670,400
プレス工業	40,300	437.000	17,611,100

ミクニ	15,200	322.000	4,894,400
太平洋工業	16,500	1,098.000	18,117,000
アイシン	61,700	4,075.000	251,427,500
マツダ	249,700	1,193.000	297,892,100
本田技研工業	619,400	3,577.000	2,215,593,800
スズキ	168,100	4,981.000	837,306,100
S U B A R U	223,200	2,542.500	567,486,000
ヤマハ発動機	110,400	2,900.000	320,160,000
T B K	18,500	308.000	5,698,000
エクセディ	13,200	1,806.000	23,839,200
豊田合成	24,100	2,348.000	56,586,800
愛三工業	14,400	733.000	10,555,200
日本プラスト	21,700	453.000	9,830,100
ヨロズ	8,500	874.000	7,429,000
エフ・シー・シー	13,900	1,440.000	20,016,000
シマノ	28,800	24,065.000	693,072,000
テイ・エス テック	36,000	1,543.000	55,548,000
テルモ	239,700	4,406.000	1,056,118,200
日機装	18,500	1,011.000	18,703,500
日本エム・ディ・エム	5,200	1,230.000	6,396,000
島津製作所	100,900	3,980.000	401,582,000
J M S	4,000	555.000	2,220,000
長野計器	6,400	1,063.000	6,803,200
ブイ・テクノロジー	4,100	2,862.000	11,734,200
東京計器	6,600	1,219.000	8,045,400
愛知時計電機	4,000	1,425.000	5,700,000
インターアクション	4,600	1,680.000	7,728,000
東京精密	13,200	4,690.000	61,908,000
マニー	31,400	1,811.000	56,865,400
ニコン	119,700	1,482.000	177,395,400
トプコン	40,100	1,836.000	73,623,600
オリンパス	406,100	3,017.000	1,225,203,700
理研計器	5,600	4,485.000	25,116,000
タムロン	5,200	3,060.000	15,912,000
H O Y A	163,600	14,780.000	2,418,008,000
ノーリツ鋼機	6,900	2,575.000	17,767,500
A & D ホロンホールディングス	9,500	903.000	8,578,500
朝日インテック	93,100	2,408.000	224,184,800
シチズン時計	83,000	614.000	50,962,000
リズム	3,300	1,420.000	4,686,000
メニコン	26,200	3,065.000	80,303,000
松風	3,400	2,258.000	7,677,200
セイコーホールディングス	12,000	2,875.000	34,500,000
ニプロ	60,300	1,110.000	66,933,000
スノーピーク	12,300	2,094.000	25,756,200
パラマウントベッドホールディングス	16,000	2,619.000	41,904,000
トランザクション	6,200	1,053.000	6,528,600
ニホンフラッシュ	7,200	982.000	7,070,400

前田工織	7,700	3,315.000	25,525,500
永大産業	30,800	246.000	7,576,800
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	10,060.000	705,206,000
SHOEI	7,400	5,430.000	40,182,000
フランスベッドホールディングス	12,500	929.000	11,612,500
パイロットコーポレーション	11,000	5,450.000	59,950,000
萩原工業	5,500	1,060.000	5,830,000
フジシールインターナショナル	17,500	1,509.000	26,407,500
タカラトミー	35,100	1,305.000	45,805,500
広済堂ホールディングス	5,900	1,270.000	7,493,000
プロネクサス	7,000	975.000	6,825,000
ウッドワン	5,900	1,139.000	6,720,100
大建工業	4,700	1,898.000	8,920,600
凸版印刷	109,600	2,224.000	243,750,400
大日本印刷	91,300	2,995.000	273,443,500
共同印刷	2,700	2,491.000	6,725,700
NISSHA	13,400	1,888.000	25,299,200
TAKARA & COMPANY	5,800	2,084.000	12,087,200
アシックス	65,000	2,584.000	167,960,000
ローランド	5,300	4,175.000	22,127,500
小松ウオール工業	2,500	1,889.000	4,722,500
ヤマハ	49,000	5,200.000	254,800,000
河合楽器製作所	2,300	2,765.000	6,359,500
クリナップ	8,900	604.000	5,375,600
ビジョン	45,500	2,108.000	95,914,000
キングジム	7,600	905.000	6,878,000
リンテック	16,000	2,329.000	37,264,000
イトーキ	17,000	429.000	7,293,000
任天堂	47,800	62,400.000	2,982,720,000
三菱鉛筆	9,900	1,406.000	13,919,400
タカラスタンダード	13,000	1,315.000	17,095,000
コクヨ	33,600	1,808.000	60,748,800
ナカバヤシ	7,300	510.000	3,723,000
グローブライド	6,400	2,504.000	16,025,600
オカムラ	23,300	1,356.000	31,594,800
美津濃	7,000	2,708.000	18,956,000
東京電力ホールディングス	635,200	488.000	309,977,600
中部電力	237,900	1,386.000	329,729,400
関西電力	295,500	1,280.000	378,240,000
中国電力	122,900	765.000	94,018,500
北陸電力	73,700	495.000	36,481,500
東北電力	185,400	693.000	128,482,200
四国電力	71,200	777.000	55,322,400
九州電力	161,700	792.000	128,066,400
北海道電力	75,700	507.000	38,379,900
沖縄電力	19,200	1,094.000	21,004,800
電源開発	62,900	2,097.000	131,901,300

エフオン	6,600	666.000	4,395,600
イーレックス	11,100	2,900.000	32,190,000
レノバ	16,700	3,790.000	63,293,000
東京瓦斯	150,900	2,526.000	381,173,400
大阪瓦斯	142,200	2,245.000	319,239,000
東邦瓦斯	33,300	2,963.000	98,667,900
北海道瓦斯	4,900	1,633.000	8,001,700
広島ガス	6,700	326.000	2,184,200
西部ガスホールディングス	7,800	1,771.000	13,813,800
静岡ガス	15,500	1,022.000	15,841,000
メタウォーター	8,600	1,998.000	17,182,800
SBSホールディングス	6,100	2,907.000	17,732,700
東武鉄道	76,800	3,410.000	261,888,000
相鉄ホールディングス	25,400	2,394.000	60,807,600
東急	196,100	1,733.000	339,841,300
京浜急行電鉄	94,700	1,476.000	139,777,200
小田急電鉄	106,400	1,899.000	202,053,600
京王電鉄	37,200	5,500.000	204,600,000
京成電鉄	52,200	4,035.000	210,627,000
富士急行	8,700	4,490.000	39,063,000
東日本旅客鉄道	129,500	7,681.000	994,689,500
西日本旅客鉄道	90,500	5,747.000	520,103,500
東海旅客鉄道	59,700	17,035.000	1,016,989,500
西武ホールディングス	102,600	1,561.000	160,158,600
鴻池運輸	12,000	1,431.000	17,172,000
西日本鉄道	20,100	2,897.000	58,229,700
ハマキョウレックス	5,400	3,245.000	17,523,000
サカイ引越センター	3,800	4,875.000	18,525,000
近鉄グループホールディングス	75,100	4,860.000	364,986,000
阪急阪神ホールディングス	92,900	4,360.000	405,044,000
南海電気鉄道	33,800	2,883.000	97,445,400
京阪ホールディングス	31,400	3,660.000	114,924,000
神戸電鉄	2,800	3,420.000	9,576,000
名古屋鉄道	77,900	2,239.000	174,418,100
山陽電気鉄道	6,400	2,176.000	13,926,400
アルプス物流	5,400	1,126.000	6,080,400
ヤマトホールディングス	110,000	2,171.000	238,810,000
山九	19,400	4,265.000	82,741,000
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	983.000	36,174,400
トナミホールディングス	1,600	3,700.000	5,920,000
ニッコンホールディングス	24,000	2,401.000	57,624,000
福山通運	10,100	3,235.000	32,673,500
セイノーホールディングス	43,000	1,153.000	49,579,000
神奈川中央交通	2,300	3,585.000	8,245,500
日立物流	15,500	8,790.000	136,245,000
丸和運輸機関	13,700	1,590.000	21,783,000
C & F ロジホールディングス	7,400	1,178.000	8,717,200

九州旅客鉄道	54,600	3,125.000	170,625,000
S Gホールディングス	134,300	2,151.000	288,879,300
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	26,000	7,620.000	198,120,000
日本郵船	66,800	10,040.000	670,672,000
商船三井	123,300	3,410.000	420,453,000
川崎汽船	24,700	8,040.000	198,588,000
N Sユナイテッド海運	3,800	4,575.000	17,385,000
明治海運	9,900	780.000	7,722,000
飯野海運	32,400	751.000	24,332,400
乾汽船	6,400	1,812.000	11,596,800
日本航空	171,400	2,700.000	462,780,000
A N Aホールディングス	191,700	2,806.500	538,006,050
パスコ	4,000	1,301.000	5,204,000
トランコム	2,300	8,190.000	18,837,000
日新	6,500	1,916.000	12,454,000
三菱倉庫	19,500	3,535.000	68,932,500
三井倉庫ホールディングス	8,200	3,375.000	27,675,000
住友倉庫	23,600	2,160.000	50,976,000
澁澤倉庫	4,400	2,075.000	9,130,000
東陽倉庫	31,000	273.000	8,463,000
日本トランスシティ	14,700	505.000	7,423,500
川西倉庫	3,300	1,046.000	3,451,800
東洋埠頭	2,900	1,223.000	3,546,700
上組	38,100	2,728.000	103,936,800
キューソー流通システム	9,800	1,375.000	13,475,000
エーアイティー	5,500	1,531.000	8,420,500
内外トランスライン	3,100	2,297.000	7,120,700
日本コンセプト	2,900	1,759.000	5,101,100
N E C ネットエスアイ	27,100	1,637.000	44,362,700
クロスキャット	5,500	1,520.000	8,360,000
システナ	116,900	431.000	50,383,900
デジタルアーツ	4,600	6,700.000	30,820,000
日鉄ソリューションズ	14,200	3,560.000	50,552,000
キューブシステム	5,300	1,013.000	5,368,900
コア	3,900	1,403.000	5,471,700
手間いらず	1,200	5,250.000	6,300,000
ラクーンホールディングス	7,800	1,205.000	9,399,000
ソリトンシステムズ	4,900	1,131.000	5,541,900
ソフトクリエイトホールディングス	3,800	3,435.000	13,053,000
T I S	72,400	4,135.000	299,374,000
グリー	39,600	879.000	34,808,400
コーエーテクモホールディングス	26,500	4,670.000	123,755,000
三菱総合研究所	3,500	4,385.000	15,347,500
ファインデックス	8,000	600.000	4,800,000
ブレインパッド	7,700	998.000	7,684,600
K L a b	15,700	438.000	6,876,600
ポールトゥウィンホールディングス	12,900	950.000	12,255,000

ネクソン	189,800	2,662.000	505,247,600
エムアップホールディングス	10,100	1,736.000	17,533,600
エイチーム	7,000	816.000	5,712,000
エニグモ	11,400	564.000	6,429,600
コロブラ	27,700	700.000	19,390,000
ブロードリーフ	44,100	535.000	23,593,500
デジタルハーツホールディングス	4,400	1,798.000	7,911,200
システム情報	7,000	978.000	6,846,000
メディアドゥ	3,300	2,066.000	6,817,800
じげん	27,100	338.000	9,159,800
ブイキューブ	9,300	1,246.000	11,587,800
ディー・エル・イー	8,600	347.000	2,984,200
フィックスターズ	8,800	1,126.000	9,908,800
CARTA HOLDINGS	4,000	1,743.000	6,972,000
オブティム	7,300	888.000	6,482,400
セレス	3,600	1,033.000	3,718,800
SHIFT	5,200	20,330.000	105,716,000
ティーガイア	7,600	1,670.000	12,692,000
テクマトリックス	14,600	1,652.000	24,119,200
プロシップ	3,200	1,430.000	4,576,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	22,000	2,263.000	49,786,000
GMOペイメントゲートウェイ	16,200	10,970.000	177,714,000
システムリサーチ	2,700	1,918.000	5,178,600
インターネットイニシアティブ	22,100	4,765.000	105,306,500
さくらインターネット	11,600	553.000	6,414,800
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2,300	5,060.000	11,638,000
SRAホールディングス	4,400	3,080.000	13,552,000
朝日ネット	9,200	613.000	5,639,600
eBASE	11,400	574.000	6,543,600
アバント	9,100	1,403.000	12,767,300
アドソル日進	3,800	1,506.000	5,722,800
フリービット	5,800	884.000	5,127,200
コムチュア	9,300	2,296.000	21,352,800
アステリア	7,300	822.000	6,000,600
アイル	4,100	1,751.000	7,179,100
マークラインズ	4,400	2,419.000	10,643,600
メディカル・データ・ビジョン	11,400	1,025.000	11,685,000
gumi	13,500	987.000	13,324,500
テラスカイ	3,800	2,064.000	7,843,200
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,600	1,551.000	7,134,600
ネオジャパン	3,700	1,010.000	3,737,000
PR TIMES	2,200	2,467.000	5,427,400
ラクス	38,400	1,564.000	60,057,600
ダブルスタンダード	3,000	2,447.000	7,341,000
オープンドア	5,400	2,298.000	12,409,200
アカツキ	4,200	2,245.000	9,429,000
UBICOMホールディングス	2,600	2,342.000	6,089,200
カナミックネットワーク	13,000	540.000	7,020,000



チェンジ	17,400	1,873.000	32,590,200
オークネット	4,100	2,294.000	9,405,400
エイトレッド	3,000	1,801.000	5,403,000
マクロミル	17,100	1,176.000	20,109,600
オロ	2,800	1,708.000	4,782,400
ユーザーローカル	3,100	1,592.000	4,935,200
マネーフォワード	14,600	3,510.000	51,246,000
電算システムホールディングス	3,800	2,368.000	8,998,400
プロトコーポレーション	9,500	1,079.000	10,250,500
野村総合研究所	144,500	3,600.000	520,200,000
サイバネットシステム	10,800	967.000	10,443,600
日本システム技術	1,900	2,639.000	5,014,100
インタージホールディングス	10,100	1,664.000	16,806,400
ソースネクスト	41,100	284.000	11,672,400
インフォコム	9,100	1,957.000	17,808,700
シンプレクス・ホールディングス	13,500	2,070.000	27,945,000
HEROZ	3,300	1,179.000	3,890,700
ラクスル	10,200	2,788.000	28,437,600
メルカリ	30,200	2,321.000	70,094,200
I P S	2,600	3,055.000	7,943,000
システムサポート	3,700	1,449.000	5,361,300
イーソル	5,600	601.000	3,365,600
アルテリア・ネットワークス	9,400	1,293.000	12,154,200
ウイングアーク1 s t	6,600	1,916.000	12,645,600
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,300	1,710.000	3,933,000
サーバーワークス	1,700	2,522.000	4,287,400
S a n s a n	27,100	1,436.000	38,915,600
ギフトィ	8,400	2,502.000	21,016,800
ベース	1,300	7,080.000	9,204,000
J M D C	10,500	5,560.000	58,380,000
フォーカスシステムズ	7,000	997.000	6,979,000
クレスコ	6,300	1,747.000	11,006,100
フジ・メディア・ホールディングス	73,800	1,093.000	80,663,400
オービック	26,100	20,300.000	529,830,000
ジャストシステム	11,900	3,295.000	39,210,500
T D C ソフト	6,900	1,216.000	8,390,400
Zホールディングス	1,200,800	419.200	503,375,360
トレンドマイクロ	40,900	8,410.000	343,969,000
日本オラクル	13,900	8,020.000	111,478,000
アルファシステムズ	2,200	4,345.000	9,559,000
フューチャー	17,500	1,639.000	28,682,500
C A C H O L D I N G S	4,500	1,443.000	6,493,500
S B テクノロジー	4,000	2,451.000	9,804,000
オービックビジネスコンサルタント	7,900	4,910.000	38,789,000
伊藤忠テクノソリューションズ	37,800	3,415.000	129,087,000
アイティフォー	11,300	777.000	8,780,100
東計電算	1,500	6,100.000	9,150,000

大塚商会	40,000	4,575.000	183,000,000
サイボウズ	10,600	1,485.000	15,741,000
電通国際情報サービス	8,400	4,470.000	37,548,000
A C C E S S	10,800	737.000	7,959,600
デジタルガレージ	13,800	3,775.000	52,095,000
イーエムシステムズ	12,400	849.000	10,527,600
ウェザーニューズ	2,600	7,820.000	20,332,000
C I J	8,000	746.000	5,968,000
ビジネスエンジニアリング	2,200	2,224.000	4,892,800
WOWOW	4,600	1,342.000	6,173,200
スカラ	10,200	709.000	7,231,800
I M A G I C A G R O U P	7,000	934.000	6,538,000
ネットワンシステムズ	30,900	2,966.000	91,649,400
アルゴグラフィックス	6,400	3,890.000	24,896,000
マーベラス	14,800	670.000	9,916,000
エイベックス	15,300	1,578.000	24,143,400
B I P R O G Y	26,200	3,195.000	83,709,000
兼松エレクトロニクス	4,400	4,060.000	17,864,000
都築電気	4,400	1,319.000	5,803,600
T B S ホールディングス	40,300	1,606.000	64,721,800
日本テレビホールディングス	69,100	1,163.000	80,363,300
朝日放送グループホールディングス	10,600	642.000	6,805,200
テレビ朝日ホールディングス	19,900	1,428.000	28,417,200
スカパーJ S A Tホールディングス	71,200	544.000	38,732,800
テレビ東京ホールディングス	5,400	1,946.000	10,508,400
ビジョン	9,800	1,478.000	14,484,400
U S E N - N E X T H O L D I N G S	6,600	2,061.000	13,602,600
コネクシオ	5,700	1,252.000	7,136,400
日本通信	74,900	229.000	17,152,100
日本電信電話	931,900	3,863.000	3,599,929,700
K D D I	606,300	4,324.000	2,621,641,200
ソフトバンク	1,260,000	1,500.500	1,890,630,000
光通信	9,600	17,870.000	171,552,000
エムティーアイ	8,700	506.000	4,402,200
G M O インターネットグループ	26,500	2,715.000	71,947,500
ファイバーゲート	5,500	927.000	5,098,500
K A D O K A W A	45,000	2,711.000	121,995,000
学研ホールディングス	13,100	959.000	12,562,900
ゼンリン	13,600	920.000	12,512,000
アイネット	5,300	1,315.000	6,969,500
松竹	4,900	11,920.000	58,408,000
東宝	49,000	5,150.000	252,350,000
東映	2,300	17,440.000	40,112,000
エヌ・ティ・ティ・データ	220,600	1,980.000	436,788,000
ピー・シー・エー	5,500	1,079.000	5,934,500
ビジネスブレイン太田昭和	3,700	1,491.000	5,516,700
D T S	14,900	3,590.000	53,491,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	38,700	6,200.000	239,940,000

シーイーシー	9,600	1,460.000	14,016,000
カブコン	78,300	3,655.000	286,186,500
アイ・エス・ピー	2,000	1,265.000	2,530,000
ジャステック	5,400	1,218.000	6,577,200
S C S K	57,200	2,262.000	129,386,400
N S W	3,300	2,230.000	7,359,000
アイネス	7,800	1,529.000	11,926,200
T K C	12,200	3,510.000	42,822,000
富士ソフト	7,900	8,190.000	64,701,000
N S D	25,400	2,499.000	63,474,600
コナミグループ	30,200	7,120.000	215,024,000
福井コンピュータホールディングス	3,900	3,585.000	13,981,500
J B C Cホールディングス	6,100	1,850.000	11,285,000
ミロク情報サービス	8,400	1,517.000	12,742,800
ソフトバンクグループ	498,800	5,438.000	2,712,474,400
高千穂交易	3,500	2,196.000	7,686,000
伊藤忠食品	1,700	4,970.000	8,449,000
エレマテック	6,800	1,379.000	9,377,200
あらた	6,200	4,210.000	26,102,000
トーメンデバイス	1,400	5,680.000	7,952,000
東京エレクトロン デバイス	2,500	5,670.000	14,175,000
フィールズ	8,300	1,503.000	12,474,900
双日	85,700	2,357.000	201,994,900
アルフレッサ ホールディングス	86,700	1,683.000	145,916,100
横浜冷凍	23,200	910.000	21,112,000
アルコニックス	11,500	1,367.000	15,720,500
神戸物産	57,600	3,625.000	208,800,000
あい ホールディングス	11,500	2,184.000	25,116,000
ダイワボウホールディングス	35,400	1,929.000	68,286,600
マクニカホールディングス	19,700	2,858.000	56,302,600
ラクト・ジャパン	3,300	2,205.000	7,276,500
グリムス	3,900	1,701.000	6,633,900
バイタルケーエスケー・ホールディングス	14,600	658.000	9,606,800
八洲電機	7,300	1,002.000	7,314,600
メディアスホールディングス	5,900	708.000	4,177,200
レスターホールディングス	7,700	2,017.000	15,530,900
ジュテックホールディングス	5,000	1,091.000	5,455,000
T O K A Iホールディングス	40,600	883.000	35,849,800
三洋貿易	7,900	1,075.000	8,492,500
ビューティガレージ	1,800	2,850.000	5,130,000
ウイン・パートナーズ	6,000	957.000	5,742,000
シップヘルスケアホールディングス	24,500	2,625.000	64,312,500
コメダホールディングス	19,400	2,343.000	45,454,200
フルサト・マルカホールディングス	7,500	3,265.000	24,487,500
ヤマエグループホールディングス	5,500	1,606.000	8,833,000
小野建	8,400	1,477.000	12,406,800
伯東	5,100	3,610.000	18,411,000
コンドーテック	7,400	1,010.000	7,474,000

ナガイレーベン	10,200	1,945.000	19,839,000
三菱食品	9,500	3,275.000	31,112,500
松田産業	6,300	2,362.000	14,880,600
第一興商	16,000	4,035.000	64,560,000
メディバルホールディングス	77,400	1,855.000	143,577,000
S P K	4,300	1,392.000	5,985,600
萩原電気ホールディングス	3,500	2,247.000	7,864,500
アズワン	12,000	6,120.000	73,440,000
スズデン	4,400	2,039.000	8,971,600
尾家産業	4,700	851.000	3,999,700
シモジマ	5,800	1,086.000	6,298,800
ドウシシャ	7,600	1,500.000	11,400,000
高速	4,500	1,521.000	6,844,500
丸文	8,400	824.000	6,921,600
ハピネット	6,900	1,584.000	10,929,600
日本ライフライン	25,700	1,001.000	25,725,700
タカショー	8,400	682.000	5,728,800
I D O M	26,300	874.000	22,986,200
進和	5,300	2,189.000	11,601,700
ダイترون	3,400	2,102.000	7,146,800
シークス	11,000	1,140.000	12,540,000
オーハシテクニカ	5,300	1,403.000	7,435,900
白銅	3,100	2,605.000	8,075,500
伊藤忠商事	499,900	3,784.000	1,891,621,600
丸紅	723,100	1,415.000	1,023,186,500
高島	2,000	2,598.000	5,196,000
長瀬産業	37,300	2,034.000	75,868,200
蝶理	4,600	2,040.000	9,384,000
豊田通商	74,000	4,955.000	366,670,000
三共生興	16,200	467.000	7,565,400
兼松	28,400	1,502.000	42,656,800
三井物産	604,800	3,283.000	1,985,558,400
日本紙パルプ商事	4,000	4,475.000	17,900,000
カメイ	9,100	1,106.000	10,064,600
スターゼン	5,900	2,035.000	12,006,500
山善	29,100	917.000	26,684,700
椿本興業	1,500	3,725.000	5,587,500
住友商事	493,800	1,963.000	969,329,400
内田洋行	3,400	4,350.000	14,790,000
三菱商事	547,200	4,393.000	2,403,849,600
第一実業	3,600	3,850.000	13,860,000
キヤノンマーケティングジャパン	17,200	3,200.000	55,040,000
西華産業	4,300	1,618.000	6,957,400
佐藤商事	6,100	1,162.000	7,088,200
菱洋エレクトロ	5,600	2,293.000	12,840,800
東京産業	8,000	784.000	6,272,000
ユアサ商事	6,600	3,560.000	23,496,000
神鋼商事	2,000	4,135.000	8,270,000

阪和興業	14,300	3,700.000	52,910,000
正栄食品工業	5,100	4,280.000	21,828,000
カナデン	7,800	1,066.000	8,314,800
菱電商事	7,100	1,618.000	11,487,800
岩谷産業	18,600	5,490.000	102,114,000
ナイス	4,100	1,542.000	6,322,200
極東貿易	5,800	1,342.000	7,783,600
アステナホールディングス	14,000	447.000	6,258,000
三愛オブリ	18,700	1,118.000	20,906,600
稲畑産業	16,600	2,488.000	41,300,800
G S I クレオス	5,100	1,507.000	7,685,700
明和産業	8,400	787.000	6,610,800
ワキタ	15,800	1,121.000	17,711,800
東邦ホールディングス	23,300	1,853.000	43,174,900
サンゲツ	20,600	1,642.000	33,825,200
ミツウロコグループホールディングス	12,900	1,005.000	12,964,500
シナネンホールディングス	2,900	3,740.000	10,846,000
伊藤忠エネクス	17,700	1,066.000	18,868,200
サンリオ	23,700	3,850.000	91,245,000
サンワ テクノス	4,900	1,374.000	6,732,600
リョーサン	8,700	2,313.000	20,123,100
新光商事	12,600	967.000	12,184,200
トーヨー	4,100	1,524.000	6,248,400
三信電気	4,300	1,763.000	7,580,900
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	3,115.000	34,888,000
加賀電子	6,700	4,125.000	27,637,500
ソーダニッカ	9,300	608.000	5,654,400
立花エレテック	5,600	1,615.000	9,044,000
P A L T A C	11,700	4,150.000	48,555,000
三谷産業	17,300	304.000	5,259,200
太平洋興発	7,300	700.000	5,110,000
西本Wismettacホールディングス	2,000	3,740.000	7,480,000
コア商事ホールディングス	5,900	650.000	3,835,000
国際紙パルプ商事	17,100	733.000	12,534,300
ヤマタネ	4,900	1,605.000	7,864,500
日鉄物産	4,800	5,360.000	25,728,000
泉州電業	1,900	5,640.000	10,716,000
トラスコ中山	15,600	1,966.000	30,669,600
オートバックスセブン	27,200	1,423.000	38,705,600
モリト	7,300	708.000	5,168,400
加藤産業	8,800	3,410.000	30,008,000
イノテック	5,800	1,349.000	7,824,200
イエローハット	12,900	1,834.000	23,658,600
J Kホールディングス	6,400	1,043.000	6,675,200
日伝	5,800	1,785.000	10,353,000
杉本商事	4,000	1,850.000	7,400,000
因幡電機産業	20,000	2,711.000	54,220,000

東テク	2,600	3,505.000	9,113,000
ミスミグループ本社	104,700	3,325.000	348,127,500
タキヒヨー	6,000	811.000	4,866,000
スズケン	30,000	3,300.000	99,000,000
ジェコス	4,500	805.000	3,622,500
ローソン	18,700	4,645.000	86,861,500
サンエー	5,300	4,245.000	22,498,500
カワチ薬品	6,600	2,083.000	13,747,800
エービーシー・マート	12,900	6,220.000	80,238,000
ハードオフコーポレーション	5,600	1,354.000	7,582,400
アスクル	18,300	1,847.000	33,800,100
ゲオホールディングス	10,500	1,682.000	17,661,000
アダストリア	9,200	2,159.000	19,862,800
くら寿司	8,900	3,100.000	27,590,000
キャンドウ	4,700	2,188.000	10,283,600
パルグループホールディングス	7,400	2,393.000	17,708,200
エディオン	37,500	1,167.000	43,762,500
サーラコーポレーション	16,100	806.000	12,976,600
ハローズ	3,700	2,947.000	10,903,900
フジオフードグループ本社	7,100	1,335.000	9,478,500
あみやき亭	1,200	2,919.000	3,502,800
大黒天物産	2,700	5,830.000	15,741,000
ハニーズホールディングス	7,100	1,221.000	8,669,100
アルペン	6,200	2,101.000	13,026,200
クオールホールディングス	10,400	1,218.000	12,667,200
ジinzホールディングス	4,600	4,435.000	20,401,000
ビックカメラ	49,100	1,142.000	56,072,200
D C Mホールディングス	48,900	1,028.000	50,269,200
Monotaro	105,500	2,263.000	238,746,500
アークランドサービスホールディングス	6,100	2,097.000	12,791,700
J . フロント リテイリング	93,000	1,208.000	112,344,000
ドトール・日レスホールディングス	12,800	1,686.000	21,580,800
マツキヨココカラ&カンパニー	48,800	5,910.000	288,408,000
ブロンコビリー	4,600	2,439.000	11,219,400
Z O Z O	57,600	3,075.000	177,120,000
トレジャー・ファクトリー	2,900	1,934.000	5,608,600
物語コーポレーション	4,200	7,180.000	30,156,000
三越伊勢丹ホールディングス	125,400	1,227.000	153,865,800
Hamee	3,900	1,028.000	4,009,200
ウエルシアホールディングス	44,200	2,925.000	129,285,000
クリエイトSDホールディングス	11,700	3,095.000	36,211,500
チムニー	9,900	1,239.000	12,266,100
シュッピン	7,500	1,260.000	9,450,000
オイシックス・ラ・大地	12,300	1,877.000	23,087,100
ネクステージ	17,000	3,240.000	55,080,000
ジョイフル本田	23,500	1,755.000	41,242,500
鳥貴族ホールディングス	3,600	2,341.000	8,427,600
ホットランド	7,200	1,320.000	9,504,000

すかいらーくホールディングス	102,300	1,531.000	156,621,300
SFPホールディングス	4,400	1,726.000	7,594,400
綿半ホールディングス	6,100	1,390.000	8,479,000
ヨシックスホールディングス	2,100	2,311.000	4,853,100
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	1,052.000	29,245,600
ゴルフダイジェスト・オンライン	3,900	1,981.000	7,725,900
B E E N O S	4,500	2,466.000	11,097,000
あさひ	6,700	1,316.000	8,817,200
日本調剤	5,600	1,246.000	6,977,600
コスモス薬品	8,500	13,710.000	116,535,000
セブン&アイ・ホールディングス	279,900	5,925.000	1,658,407,500
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	56,400	917.000	51,718,800
ツルハホールディングス	18,300	7,880.000	144,204,000
サンマルクホールディングス	7,600	1,617.000	12,289,200
フェリシモ	2,500	1,036.000	2,590,000
トリドールホールディングス	20,900	3,095.000	64,685,500
JMホールディングス	6,900	1,678.000	11,578,200
アレンザホールディングス	6,000	978.000	5,868,000
串カツ田中ホールディングス	3,700	1,801.000	6,663,700
パロックジャパンリミテッド	6,400	784.000	5,017,600
クスリのアオキホールディングス	7,500	6,450.000	48,375,000
FOOD & LIFE COMPANIES	42,800	2,405.000	102,934,000
メディカルシステムネットワーク	9,300	416.000	3,868,800
ノジマ	13,300	2,661.000	35,391,300
カップバ・クリエイト	12,100	1,435.000	17,363,500
ライトオン	4,000	693.000	2,772,000
良品計画	96,300	1,295.000	124,708,500
アドヴァングループ	14,000	853.000	11,942,000
アルビス	2,800	2,318.000	6,490,400
G-7ホールディングス	9,100	1,469.000	13,367,900
イオン北海道	14,500	1,142.000	16,559,000
コジマ	14,200	630.000	8,946,000
コーナン商事	11,800	3,295.000	38,881,000
エコス	3,200	1,823.000	5,833,600
ワタミ	11,000	924.000	10,164,000
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	2,683.000	447,792,700
西松屋チェーン	16,600	1,524.000	25,298,400
ゼンショーホールディングス	40,500	3,590.000	145,395,000
幸楽苑ホールディングス	6,300	1,074.000	6,766,200
サイゼリヤ	12,800	2,679.000	34,291,200
VTホールディングス	31,100	487.000	15,145,700
フジ・コーポレーション	4,700	1,236.000	5,809,200
ユナイテッドアローズ	9,100	1,902.000	17,308,200
ハイデイ日高	11,900	2,060.000	24,514,000
コロワイド	34,900	1,916.000	66,868,400
荅番屋	5,600	4,475.000	25,060,000

スギホールディングス	16,700	6,020.000	100,534,000
薬王堂ホールディングス	4,300	2,303.000	9,902,900
スクロール	13,200	747.000	9,860,400
ヨンドシーホールディングス	7,300	1,792.000	13,081,600
木曽路	11,900	2,146.000	25,537,400
S R Sホールディングス	15,600	876.000	13,665,600
千趣会	15,800	389.000	6,146,200
リテールパートナーズ	10,800	1,075.000	11,610,000
ケーヨー	15,900	885.000	14,071,500
上新電機	7,500	1,892.000	14,190,000
日本瓦斯	40,200	2,200.000	88,440,000
ロイヤルホールディングス	14,500	2,181.000	31,624,500
いなげや	8,100	1,203.000	9,744,300
チヨダ	9,600	780.000	7,488,000
ライフコーポレーション	6,500	2,640.000	17,160,000
リンガーハット	10,500	2,189.000	22,984,500
MrMaxHD	11,400	620.000	7,068,000
AOKIホールディングス	15,900	717.000	11,400,300
オークワ	12,300	931.000	11,451,300
コメリ	12,500	2,608.000	32,600,000
青山商事	17,000	965.000	16,405,000
しまむら	9,700	12,260.000	118,922,000
高島屋	56,800	1,684.000	95,651,200
松屋	14,600	1,038.000	15,154,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	36,200	1,143.000	41,376,600
近鉄百貨店	5,100	2,411.000	12,296,100
丸井グループ	60,200	2,475.000	148,995,000
アクシアル リテイリング	5,300	3,270.000	17,331,000
イオン	275,300	2,672.500	735,739,250
イズミ	13,200	3,030.000	39,996,000
平和堂	11,700	2,014.000	23,563,800
フジ	18,300	1,884.000	34,477,200
ヤオコー	9,400	6,510.000	61,194,000
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	1,212.000	85,930,800
OLYMPICグループ	10,200	583.000	5,946,600
Genky DrugStores	3,800	3,625.000	13,775,000
ブックオフグループホールディングス	5,600	1,035.000	5,796,000
ギフトホールディングス	1,900	3,460.000	6,574,000
アインホールディングス	10,300	6,500.000	66,950,000
元気寿司	4,500	2,998.000	13,491,000
ヤマダホールディングス	295,600	477.000	141,001,200
アーケランズ	13,500	1,468.000	19,818,000
ニトリホールディングス	33,200	12,940.000	429,608,000
グルメ杵屋	8,900	1,018.000	9,060,200
ケーユーホールディングス	2,000	1,165.000	2,330,000
吉野家ホールディングス	29,600	2,317.000	68,583,200
松屋フーズホールディングス	3,900	3,790.000	14,781,000



サガミホールディングス	13,500	1,235.000	16,672,500
関西フードマーケット	8,100	1,157.000	9,371,700
王将フードサービス	5,200	6,400.000	33,280,000
プレナス	9,100	1,915.000	17,426,500
ミニストップ	7,400	1,415.000	10,471,000
アークス	14,100	2,032.000	28,651,200
パローホールディングス	16,300	1,786.000	29,111,800
ベルク	3,500	5,450.000	19,075,000
大 庄	9,800	1,149.000	11,260,200
ファーストリテイリング	11,200	82,450.000	923,440,000
サンドラッグ	31,400	3,495.000	109,743,000
サックスパー ホールディングス	9,900	698.000	6,910,200
やまや	1,000	2,595.000	2,595,000
ベルーナ	17,500	720.000	12,600,000
めぶきフィナンシャルグループ	345,300	274.000	94,612,200
東京きらぼしフィナンシャルグループ	9,800	2,230.000	21,854,000
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	1,031.000	202,282,200
富山第一銀行	20,200	420.000	8,484,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	411,600	454.000	186,866,400
西日本フィナンシャルホールディングス	44,300	743.000	32,914,900
三十三フィナンシャルグループ	7,600	1,459.000	11,088,400
第四北越フィナンシャルグループ	11,500	2,658.000	30,567,000
ひろぎんホールディングス	107,200	612.000	65,606,400
おきなわフィナンシャルグループ	7,500	2,146.000	16,095,000
十六フィナンシャルグループ	10,100	2,439.000	24,633,900
北國フィナンシャルホールディングス	7,000	4,600.000	32,200,000
プロクレアホールディングス	9,300	2,121.000	19,725,300
新生銀行	56,000	1,953.000	109,368,000
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	723.600	3,536,595,000
りそなホールディングス	882,500	532.400	469,843,000
三井住友トラスト・ホールディングス	137,800	4,265.000	587,717,000
三井住友フィナンシャルグループ	541,500	4,309.000	2,333,323,500
千葉銀行	235,100	764.000	179,616,400
群馬銀行	134,200	395.000	53,009,000
武蔵野銀行	10,500	1,697.000	17,818,500
千葉興業銀行	23,300	267.000	6,221,100
筑波銀行	42,100	187.000	7,872,700
七十七銀行	22,100	1,797.000	39,713,700
秋田銀行	5,800	1,636.000	9,488,800
山形銀行	9,900	951.000	9,414,900
岩手銀行	5,600	1,834.000	10,270,400
東邦銀行	70,200	205.000	14,391,000
ふくおかフィナンシャルグループ	60,400	2,542.000	153,536,800
静岡銀行	170,300	823.000	140,156,900
スルガ銀行	75,300	377.000	28,388,100
八十二銀行	151,600	478.000	72,464,800

山梨中央銀行	10,100	1,138.000	11,493,800
大垣共立銀行	14,400	1,717.000	24,724,800
福井銀行	8,100	1,382.000	11,194,200
清水銀行	1,900	1,458.000	2,770,200
富山銀行	4,100	1,709.000	7,006,900
滋賀銀行	13,400	2,504.000	33,553,600
南都銀行	11,200	1,971.000	22,075,200
百五銀行	71,700	318.000	22,800,600
京都銀行	25,600	5,360.000	137,216,000
紀陽銀行	24,000	1,481.000	35,544,000
ほくほくフィナンシャルグループ	48,800	845.000	41,236,000
山陰合同銀行	46,800	690.000	32,292,000
中国銀行	57,400	933.000	53,554,200
伊予銀行	91,700	658.000	60,338,600
百十四銀行	9,300	1,622.000	15,084,600
四国銀行	13,800	846.000	11,674,800
阿波銀行	10,600	1,850.000	19,610,000
大分銀行	6,000	1,853.000	11,118,000
宮崎銀行	5,700	2,193.000	12,500,100
佐賀銀行	5,400	1,529.000	8,256,600
琉球銀行	21,700	776.000	16,839,200
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	1,641.500	1,641,828,300
山口フィナンシャルグループ	84,500	776.000	65,572,000
名古屋銀行	5,300	3,085.000	16,350,500
北洋銀行	109,600	225.000	24,660,000
愛知銀行	2,800	5,720.000	16,016,000
中京銀行	3,400	1,862.000	6,330,800
愛媛銀行	12,700	853.000	10,833,100
京葉銀行	39,000	489.000	19,071,000
栃木銀行	42,300	273.000	11,547,900
東和銀行	16,400	523.000	8,577,200
トモニホールディングス	65,600	311.000	20,401,600
フィデアホールディングス	9,500	1,320.000	12,540,000
池田泉州ホールディングス	104,100	214.000	22,277,400
F P G	29,200	1,319.000	38,514,800
ジャパンインベストメントアドバイザー	6,000	1,381.000	8,286,000
S B Iホールディングス	102,800	2,712.000	278,793,600
ジャフコ グループ	29,500	2,191.000	64,634,500
大和証券グループ本社	531,600	614.900	326,880,840
野村ホールディングス	1,271,500	505.800	643,124,700
岡三証券グループ	59,100	330.000	19,503,000
丸三証券	29,000	466.000	13,514,000
東洋証券	30,100	261.000	7,856,100
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	81,200	373.000	30,287,600
水戸証券	20,800	258.000	5,366,400
いちよし証券	17,000	637.000	10,829,000
松井証券	42,000	795.000	33,390,000

マネックスグループ	71,500	480.000	34,320,000
極東証券	12,400	690.000	8,556,000
岩井コスモホールディングス	9,100	1,245.000	11,329,500
アイザワ証券グループ	11,700	630.000	7,371,000
スパークス・グループ	40,400	309.000	12,483,600
かんぽ生命保険	84,400	2,222.000	187,536,800
S O M P Oホールディングス	118,800	6,049.000	718,621,200
アニコム ホールディングス	29,100	634.000	18,449,400
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	4,146.000	709,795,200
第一生命ホールディングス	407,000	2,410.000	980,870,000
東京海上ホールディングス	232,400	7,767.000	1,805,050,800
T & Dホールディングス	186,000	1,497.000	278,442,000
アドバンスクリエイト	7,400	1,089.000	8,058,600
全国保証	20,000	4,700.000	94,000,000
ジェイリース	3,200	2,716.000	8,691,200
日本モーゲージサービス	9,600	892.000	8,563,200
アルヒ	14,400	1,317.000	18,964,800
プレミアグループ	13,200	1,921.000	25,357,200
ネットプロテクションズホールディングス	26,500	480.000	12,720,000
クレディセゾン	49,100	1,762.000	86,514,200
芙蓉総合リース	7,000	8,170.000	57,190,000
みずほリース	10,100	3,300.000	33,330,000
東京センチュリー	12,700	4,870.000	61,849,000
日本証券金融	34,300	821.000	28,160,300
アイフル	143,300	386.000	55,313,800
リコーリース	7,600	3,590.000	27,284,000
イオンフィナンシャルサービス	45,100	1,500.000	67,650,000
アコム	179,700	319.000	57,324,300
ジャックス	8,400	3,755.000	31,542,000
オリエントコーポレーション	228,000	119.000	27,132,000
オリックス	495,400	2,263.000	1,121,090,200
三菱H Cキャピタル	265,400	685.000	181,799,000
日本取引所グループ	194,900	2,029.500	395,549,550
イー・ギャランティ	13,000	2,331.000	30,303,000
N E Cキャピタルソリューション	3,800	2,101.000	7,983,800
いちご	94,800	310.000	29,388,000
日本駐車場開発	95,900	189.000	18,125,100
スター・マイカ・ホールディングス	5,400	1,577.000	8,515,800
S R Eホールディングス	2,600	3,145.000	8,177,000
ヒューリック	161,500	1,093.000	176,519,500
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	3,570.000	153,867,000
三重交通グループホールディングス	20,100	492.000	9,889,200
サムティ	10,100	2,289.000	23,118,900
ディア・ライフ	14,000	662.000	9,268,000
地主	7,000	2,041.000	14,287,000
プレサンスコーポレーション	11,400	1,579.000	18,000,600

J P M C	6,400	994.000	6,361,600
フージャースホールディングス	12,700	813.000	10,325,100
オープンハウスグループ	26,500	5,330.000	141,245,000
東急不動産ホールディングス	227,200	782.000	177,670,400
飯田グループホールディングス	68,100	2,143.000	145,938,300
A n d D oホールディングス	6,000	860.000	5,160,000
シーアールイー	4,000	1,458.000	5,832,000
ケイアイスター不動産	3,900	4,860.000	18,954,000
グッドコムアセット	4,200	1,460.000	6,132,000
ジェイ・エス・ビー	2,100	3,690.000	7,749,000
ロードスターキャピタル	3,500	1,801.000	6,303,500
パーク24	54,500	2,176.000	118,592,000
パラカ	4,400	1,939.000	8,531,600
宮越ホールディングス	3,700	913.000	3,378,100
三井不動産	326,200	2,950.000	962,290,000
三菱地所	476,500	1,956.000	932,034,000
平和不動産	13,500	4,070.000	54,945,000
東京建物	66,200	2,157.000	142,793,400
京阪神ビルディング	11,900	1,280.000	15,232,000
住友不動産	150,500	3,549.000	534,124,500
テオーシー	18,400	734.000	13,505,600
東京楽天地	2,100	4,020.000	8,442,000
スターツコーポレーション	11,100	2,743.000	30,447,300
フジ住宅	13,300	652.000	8,671,600
空港施設	12,600	552.000	6,955,200
明和地所	8,800	616.000	5,420,800
ゴールドクレスト	7,600	1,782.000	13,543,200
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	431.000	7,499,400
日本エスコン	16,200	806.000	13,057,200
タカラレーベン	40,700	391.000	15,913,700
イオンモール	42,500	1,671.000	71,017,500
カチタス	20,600	3,495.000	71,997,000
トーセイ	12,200	1,455.000	17,751,000
サンフロンティア不動産	12,500	1,183.000	14,787,500
F Jネクストホールディングス	9,400	1,035.000	9,729,000
グランディハウス	9,100	556.000	5,059,600
日本空港ビルデング	27,200	6,190.000	168,368,000
日本工営	5,400	3,730.000	20,142,000
L I F U L L	32,400	174.000	5,637,600
ミクシィ	18,900	2,420.000	45,738,000
ジェイエイシーリクルートメント	6,600	2,042.000	13,477,200
日本M & Aセンターホールディングス	133,200	1,738.000	231,501,600
メンバーズ	2,400	2,590.000	6,216,000
U Tグループ	11,800	2,752.000	32,473,600
アイティメディア	4,400	1,692.000	7,444,800
E・Jホールディングス	5,200	1,294.000	6,728,800
夢真ビーネックスグループ	26,500	1,684.000	44,626,000

コシダカホールディングス	23,000	908.000	20,884,000
パソナグループ	8,800	2,020.000	17,776,000
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	2,958.000	82,232,400
パーソルホールディングス	80,800	2,787.000	225,189,600
リニカル	6,400	742.000	4,748,800
クックパッド	43,500	210.000	9,135,000
学情	4,200	1,380.000	5,796,000
スタジオアリス	4,500	2,171.000	9,769,500
シミックホールディングス	5,500	1,616.000	8,888,000
総合警備保障	29,900	3,585.000	107,191,500
カカクコム	59,800	2,640.000	157,872,000
アイロムグループ	3,600	2,463.000	8,866,800
セントケア・ホールディング	4,000	816.000	3,264,000
ルネサンス	8,000	996.000	7,968,000
ディップ	14,300	3,845.000	54,983,500
デジタルホールディングス	6,600	1,274.000	8,408,400
新日本科学	10,400	2,676.000	27,830,400
ベネフィット・ワン	29,700	2,107.000	62,577,900
エムスリー	143,100	4,532.000	648,529,200
アウトソーシング	43,600	1,241.000	54,107,600
ワールドホールディングス	3,600	2,650.000	9,540,000
ディー・エヌ・エー	31,400	1,903.000	59,754,200
博報堂D Yホールディングス	102,400	1,143.000	117,043,200
タカミヤ	14,000	412.000	5,768,000
ジャパンベストレスキューシステム	5,300	741.000	3,927,300
ファンコミュニケーションズ	19,500	416.000	8,112,000
ライク	3,300	2,229.000	7,355,700
エスプール	21,200	1,045.000	22,154,000
WDBホールディングス	3,900	2,609.000	10,175,100
アドウェイズ	10,900	724.000	7,891,600
バリューコマース	5,400	2,404.000	12,981,600
インフォマート	77,000	437.000	33,649,000
J Pホールディングス	29,200	273.000	7,971,600
プレステージ・インターナショナル	31,600	688.000	21,740,800
アミューズ	5,100	1,918.000	9,781,800
ドリームインキュベータ	3,100	1,932.000	5,989,200
クイック	5,500	1,843.000	10,136,500
電通グループ	75,900	4,235.000	321,436,500
ぴあ	2,800	3,445.000	9,646,000
イオンファンタジー	3,600	3,780.000	13,608,000
シーティーエス	10,500	731.000	7,675,500
H . U . グループホールディングス	21,900	2,703.000	59,195,700
アルプス技研	7,000	1,816.000	12,712,000
日本空調サービス	11,100	750.000	8,325,000
オリエンタルランド	86,100	20,420.000	1,758,162,000
ダスキン	17,800	2,818.000	50,160,400
明光ネットワークジャパン	14,500	612.000	8,874,000

ファルコホールディングス	4,500	1,765.000	7,942,500
ラウンドワン	23,200	2,127.000	49,346,400
リゾートトラスト	34,800	2,353.000	81,884,400
ビー・エム・エル	10,300	3,360.000	34,608,000
りらいあコミュニケーションズ	11,600	989.000	11,472,400
リソー教育	42,800	324.000	13,867,200
早稲田アカデミー	6,200	1,089.000	6,751,800
ユー・エス・エス	90,900	2,381.000	216,432,900
東京個別指導学院	10,200	561.000	5,722,200
サイバーエージェント	173,700	1,332.000	231,368,400
楽天グループ	335,400	651.000	218,345,400
クリーク・アンド・リバー社	4,600	2,561.000	11,780,600
モーニングスター	17,300	478.000	8,269,400
テー・オー・ダブリュー	20,400	308.000	6,283,200
山田コンサルティンググループ	5,300	1,255.000	6,651,500
セントラルスポーツ	4,000	2,518.000	10,072,000
フルキャストホールディングス	7,000	2,568.000	17,976,000
エン・ジャパン	14,700	2,373.000	34,883,100
テクノプロ・ホールディングス	48,600	2,979.000	144,779,400
アイ・アールジャパンホールディングス	4,100	2,197.000	9,007,700
Keepers 技研	5,300	4,210.000	22,313,000
Gunosy	5,700	808.000	4,605,600
イー・ガーディアン	3,300	2,948.000	9,728,400
ジャパンマテリアル	24,900	1,915.000	47,683,500
ベクトル	12,000	1,142.000	13,704,000
チャーム・ケア・コーポレーション	6,800	1,123.000	7,636,400
キャリアリンク	3,300	2,270.000	7,491,000
IBJ	6,200	946.000	5,865,200
アサンテ	5,700	1,607.000	9,159,900
バリューHR	7,300	1,450.000	10,585,000
M&Aキャピタルパートナーズ	6,800	3,400.000	23,120,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,600	1,120.000	5,152,000
シグマクシス・ホールディングス	10,300	1,199.000	12,349,700
ウィルグループ	6,400	1,427.000	9,132,800
メドピア	5,900	1,505.000	8,879,500
リクルートホールディングス	580,000	4,483.000	2,600,140,000
エラン	9,300	1,060.000	9,858,000
日本郵政	886,300	985.000	873,005,500
ベルシステム24ホールディングス	12,300	1,407.000	17,306,100
鎌倉新書	11,200	871.000	9,755,200
エアトリ	5,200	3,030.000	15,756,000
アトラエ	6,100	1,580.000	9,638,000
ストライク	3,600	4,020.000	14,472,000
ソラスト	20,800	895.000	18,616,000
セラク	3,400	1,121.000	3,811,400
インソース	9,100	2,863.000	26,053,300
ペイカレント・コンサルティング	5,700	40,900.000	233,130,000
Orchestra Holdings	1,800	2,598.000	4,676,400

アイモバイル	5,000	1,284.000	6,420,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	25,700	1,943.000	49,935,100
ウェルビー	7,900	736.000	5,814,400
エル・ティー・エス	1,200	3,205.000	3,846,000
ミダックホールディングス	3,800	3,680.000	13,984,000
日総工産	7,900	605.000	4,779,500
キュービーネットホールディングス	5,200	1,417.000	7,368,400
R P Aホールディングス	15,000	301.000	4,515,000
マネジメントソリューションズ	4,200	2,805.000	11,781,000
フロンティア・マネジメント	3,200	1,212.000	3,878,400
カーブスホールディングス	23,100	850.000	19,635,000
フォーラムエンジニアリング	4,700	906.000	4,258,200
FAST FITNESS JAPAN	2,100	1,610.000	3,381,000
ダイレクトマーケティングミックス	8,700	1,614.000	14,041,800
L I T A L I C O	6,800	2,923.000	19,876,400
リログループ	44,800	2,261.000	101,292,800
東祥	8,400	1,290.000	10,836,000
ビーウィズ	3,200	1,392.000	4,454,400
T R Eホールディングス	15,700	1,710.000	26,847,000
人・夢・技術グループ	3,700	2,564.000	9,486,800
エイチ・アイ・エス	16,700	2,383.000	39,796,100
ラックランド	3,300	2,869.000	9,467,700
共立メンテナンス	14,600	6,110.000	89,206,000
イチネンホールディングス	9,100	1,270.000	11,557,000
建設技術研究所	3,900	2,934.000	11,442,600
スペース	4,000	871.000	3,484,000
燦ホールディングス	4,000	1,848.000	7,392,000
東京テアトル	2,400	1,220.000	2,928,000
ナガワ	2,200	7,550.000	16,610,000
東京都競馬	6,400	4,170.000	26,688,000
カナモト	13,700	2,079.000	28,482,300
西尾レントオール	6,700	2,929.000	19,624,300
トランス・コスモス	10,300	3,715.000	38,264,500
乃村工藝社	34,800	954.000	33,199,200
日本管財	8,500	2,601.000	22,108,500
トーカイ	6,900	1,840.000	12,696,000
セコム	79,900	8,428.000	673,397,200
セントラル警備保障	4,300	2,333.000	10,031,900
丹青社	16,600	793.000	13,163,800
メイテック	29,300	2,347.000	68,767,100
応用地質	7,300	1,864.000	13,607,200
船井総研ホールディングス	15,300	2,440.000	37,332,000
学究社	5,300	1,640.000	8,692,000
ベネッセホールディングス	27,900	2,139.000	59,678,100
イオンディライト	9,400	2,816.000	26,470,400
ダイセキ	14,800	4,375.000	64,750,000
ステップ	3,600	1,803.000	6,490,800

合計	85,629,700	211,443,637,940	
----	------------	-----------------	--

## (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15日現在)	(2022年9月15日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
預金	4,313,832,947	7,511,586,557
金銭信託	263,022,914	13,279,106
コール・ローン	80,386,695	342,134,530
株式	310,949,577,383	409,623,622,949
投資証券	7,648,181,672	10,830,115,492
派生商品評価勘定	3,425,769	1,139,620
未収入金	17,605,461	245,407,071
未収配当金	509,702,066	746,532,782
前払金	17,491,341	-
差入委託証拠金	2,262,987,707	2,866,215,725
<b>流動資産合計</b>	<b>326,066,213,955</b>	<b>432,180,033,832</b>
<b>資産合計</b>	<b>326,066,213,955</b>	<b>432,180,033,832</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
派生商品評価勘定	20,178,445	409,947,031
未払金	15,861,568	-
未払解約金	388,119,296	487,613,402
未払利息	207	-
その他未払費用	1,134	1,829
<b>流動負債合計</b>	<b>424,160,650</b>	<b>897,562,262</b>
<b>負債合計</b>	<b>424,160,650</b>	<b>897,562,262</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	59,387,331,594	69,478,969,425
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	266,254,721,711	361,803,502,145
<b>元本等合計</b>	<b>325,642,053,305</b>	<b>431,282,471,570</b>
<b>純資産合計</b>	<b>325,642,053,305</b>	<b>431,282,471,570</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>326,066,213,955</b>	<b>432,180,033,832</b>



## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2021年9月16日 至 2022年9月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## ( 重要な会計上の見積りに関する注記 )

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

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	( 2021年9月15日現在 )	( 2022年9月15日現在 )
1. 当計算期間の末日における 受益権の総数	59,387,331,594口	69,478,969,425口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 5.4834円 ( 1万口当たりの純資産額54,834円 )	1口当たり純資産額 6.2074円 ( 1万口当たりの純資産額62,074円 )

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年9月16日 至 2022年9月15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、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</p> <p>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>当計算期間については、先物取引、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	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15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15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 DEC21	5,317,139,028	-	5,300,406,438	16,732,590
	SPI 200 FUTURES DEC21	236,557,920	-	237,520,320	962,400
	FTSE 100 IDX FUT DEC21	307,863,676	-	307,453,409	410,267
	EURO STOXX 50 DEC21	1,110,283,579	-	1,108,972,696	1,310,883
	小計	6,971,844,203	-	6,954,352,863	17,491,340
	合計	6,971,844,203	-	6,954,352,863	17,491,340

(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	イスラエル・シュケ ル	3,436,200	-	3,414,910	21,290
	スウェーデン・ク ローナ	19,095,000	-	19,095,000	-

市場取引以 外の取引	小計	22,531,200	-	22,509,910	21,290
	売建				
	アメリカ・ドル	148,554,000	-	148,025,745	528,255
	イギリス・ポンド	9,137,040	-	9,083,322	53,718
	オーストラリア・ドル	4,051,100	-	4,009,965	41,135
	カナダ・ドル	6,957,920	-	6,908,696	49,224
	シンガポール・ドル	819,720	-	815,793	3,927
	スイス・フラン	5,963,550	-	5,960,065	3,485
	ユーロ	20,789,600	-	20,715,408	74,192
	香港・ドル	1,838,980	-	1,832,961	6,019
	小計	198,111,910	-	197,351,955	759,955
	合計	220,643,110	-	219,861,865	738,665

(2022年9月15日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	S&P 500 EMINI FUT DEC22	8,790,794,580	-	8,440,959,335	349,835,245
	SPI 200 FUTURES DEC22	389,794,283	-	379,902,155	9,892,128
	FTSE 100 IDX FUT DEC22	482,731,924	-	470,193,851	12,538,073
	EURO STOXX 50 DEC22	1,518,763,876	-	1,481,112,012	37,651,864
	小計	11,182,084,663	-	10,772,167,353	409,917,310
	合計	11,182,084,663	-	10,772,167,353	409,917,310

(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				

市場取引以 外の取引	カナダ・ドル	3,288,630	-	3,263,814	24,816
	デンマーク・クロー ネ	193,870	-	192,269	1,601
	ノルウェー・クロー ネ	142,871	-	142,038	833
	スウェーデン・ク ローナ	270,208	-	267,738	2,470
	小計	3,895,579	-	3,865,859	29,720
	売建				
	アメリカ・ドル	108,314,250	-	107,454,600	859,650
	香港・ドル	5,336,145	-	5,293,602	42,543
	イギリス・ポンド	8,304,700	-	8,261,530	43,170
	イスラエル・シュケ ル	419,845	-	418,164	1,681
ユーロ	23,065,280	-	22,872,704	192,576	
小計	145,440,220	-	144,300,600	1,139,620	
合 計	149,335,799	-	148,166,459	1,109,900	

## (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16日 至 2022年9月15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15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	60,178,911,589円
同期中における追加設定元本額	14,652,419,625円
同期中における一部解約元本額	15,443,999,620円

## 2021年9月15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	31,168,209,998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)	1,123,977,197円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	788,686,197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)	65,349,620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)	49,401,868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)	95,449,243円
外国株式指数ファンド	712,103,617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	11,378,684,425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)	125,860,224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	15,097,278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)	93,505,212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)	156,139,769円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	182,918,329円
三井住友・DCつみたてN I S A ・ 世界分散ファンド	37,153,110円
三井住友D S ・ 外国株式インデックス年金ファンド	409,870,740円
三井住友D S ・ 年金バランス30(債券重点型)	4,261,791円
三井住友D S ・ 年金バランス50(標準型)	17,197,702円
三井住友D S ・ 年金バランス70(株式重点型)	15,615,166円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2060	2,122,327円
S M B C ・ DCインデックスファンド(M S C I コクサイ)	84,750,468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	844,553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)	656,464,154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 >	5,585,981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 >	524,369,742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
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 >	378,468,665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 >	886,984,440円

S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 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・V A S ( 適格機関投資家専用 )	235,317,339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 >	82,477,988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 >	9,862,293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 >	8,314,514円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	4,471,755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 >	23,803,987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 >	66,591,171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 >	149,638,035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 >	68,493,967円
S M A M ・ 世界バランスファンド V A < 適格機関投資家限定 >	1,054,599,325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 >	136,159,930円
S M A M ・ 外国株式インデックスファンド S A < 適格機関投資家限定 >	1,044,221,401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 >	23,459,810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 >	48,604,306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 >	52,827,375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 >	120,158,753円
合 計	59,387,331,594円

( 2022年9月15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	59,387,331,594円
同期中における追加設定元本額	20,540,556,519円
同期中における一部解約元本額	10,448,918,688円

## 2022年9月15日現在の元本の内訳

三井住友・D C 外国株式インデックスファンド S	35,129,298,031円
三井住友・D C 年金バランス 3 0 ( 債券重点型 )	274,801,871円
三井住友・D C 年金バランス 5 0 ( 標準型 )	1,079,950,596円
三井住友・D C 年金バランス 7 0 ( 株式重点型 )	773,841,368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 )	45,603,721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 )	991,074円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 2 5 ( 4 資産タイプ )	5,203,753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 )	16,441,879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 )	48,359,688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 )	52,502,521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 )	102,719,093円
外国株式指数ファンド	909,080,991円
三井住友・D C つみたて N I S A ・ 全海外株インデックスファンド	16,732,708,111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
イオン・バランス戦略ファンド	22,350,293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	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)	222,642,765円
三井住友・資産最適化ファンド(5 成長重視型)	255,210,888円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	52,301,404円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	1,290,808,408円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	10,647,894円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	44,311,961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)	318,902,712円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	200,436,109円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	1,199,799,906円
三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド	42,559,456円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	470,984,271円
バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	3,378,368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 >	567,143,678円
SMAM・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	728,249,671円
SMAM・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	3,134,971,681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 >	301,270,219円
SMAM・バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 >	707,407,828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)	198,825,155円
SMAM・グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	60,711,309円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 >	7,719,760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	69,478,969,425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	41.740	824,740.66	
	BAKER HUGHES CO	60,981	25.390	1,548,307.59	
	CHENIERE ENERGY INC	13,763	174.170	2,397,101.71	
	CHEVRON CORP	116,154	163.270	18,964,463.58	
	CONOCOPHILLIPS	80,903	117.710	9,523,092.13	
	COTERRA ENERGY INC	49,908	32.230	1,608,534.84	
	DEVON ENERGY CORP	40,169	72.170	2,898,996.73	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	11,049	140.170	1,548,738.33	
	EOG RESOURCES INC	35,969	126.730	4,558,351.37	
	EQT CORP	19,298	50.600	976,478.80	
	EXXON MOBIL CORP	260,440	97.670	25,437,174.80	
	HALLIBURTON CO	54,852	30.400	1,667,500.80	
	HESS CORP	17,913	128.090	2,294,476.17	
	KINDER MORGAN INC	127,394	18.530	2,360,610.82	
	MARATHON OIL CORP	42,380	27.360	1,159,516.80	
	MARATHON PETROLEUM CORP	34,363	98.320	3,378,570.16	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	58,643	67.200	3,940,809.60	
	ONEOK INC	28,226	63.440	1,790,657.44	
	PHILLIPS 66	29,008	86.000	2,494,688.00	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	13,868	251.700	3,490,575.60	
	SCHLUMBERGER LTD	84,809	40.240	3,412,714.16	
	TARGA RESOURCES CORP	12,350	72.450	894,757.50	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	417	1,858.310	774,915.27	
	VALERO ENERGY CORP	24,663	109.590	2,702,818.17	
	WILLIAMS COS INC	75,529	33.450	2,526,445.05	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	13,678	255.180	3,490,352.04	
	ALBEMARLE CORP	7,433	307.050	2,282,302.65	
	ALCOA CORP	11,849	44.810	530,953.69	
	AMCOR PLC	97,610	11.740	1,145,941.40	
	AVERY DENNISON CORP	5,454	180.190	982,756.26	
	BALL CORP	19,410	57.410	1,114,328.10	
	CELANESE CORP	6,643	107.990	717,377.57	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	12,002	103.090	1,237,286.18	
CLEVELAND-CLIFFS INC	33,403	15.350	512,736.05		
CORTEVA INC	44,440	63.810	2,835,716.40		
CROWN HOLDINGS INC	6,863	97.220	667,220.86		
DOW INC	44,543	47.070	2,096,639.01		
DUPONT DE NEMOURS INC	30,490	55.810	1,701,646.90		
EASTMAN CHEMICAL CO	7,027	82.120	577,057.24		

ECOLAB INC	16,460	164.640	2,709,974.40
FMC CORP	8,548	110.990	948,742.52
FREEMPORT-MCMORAN INC	87,567	30.030	2,629,637.01
INTERNATIONAL PAPER CO	23,472	39.680	931,368.96
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	15,629	107.980	1,687,619.42
LINDE PLC	31,359	286.570	8,986,548.63
LYONDELLBASELL INDU-CL A	17,144	79.000	1,354,376.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,559	332.380	1,182,940.42
MOSAIC CO/THE	21,306	53.900	1,148,393.40
NEWMONT CORP	50,898	42.930	2,185,051.14
NUCOR CORP	15,778	120.710	1,904,562.38
PACKAGING CORP OF AMERICA	5,550	132.070	732,988.50
PPG INDUSTRIES INC	15,181	120.160	1,824,148.96
RPM INTERNATIONAL INC	7,696	92.110	708,878.56
SEALED AIR CORP	7,895	50.910	401,934.45
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	15,187	225.850	3,429,983.95
STEEL DYNAMICS INC	12,713	74.550	947,754.15
VULCAN MATERIALS CO	8,762	160.220	1,403,847.64
WESTLAKE CORP	2,189	91.890	201,147.21
WESTROCK CO	16,766	38.380	643,479.08
3M CO	35,101	117.530	4,125,420.53
AERCAP HOLDINGS NV	8,780	47.050	413,099.00
ALLEGION PLC	4,764	95.150	453,294.60
AMETEK INC	14,928	123.060	1,837,039.68
BOEING CO/THE	35,354	149.260	5,276,938.04
CARLISLE COS INC	3,499	302.700	1,059,147.30
CARRIER GLOBAL CORP	50,896	40.180	2,045,001.28
CATERPILLAR INC	32,639	184.650	6,026,791.35
CUMMINS INC	9,144	213.260	1,950,049.44
DEERE & CO	17,769	360.900	6,412,832.10
DOVER CORP	8,929	127.060	1,134,518.74
EATON CORP PLC	25,062	143.100	3,586,372.20
EMERSON ELECTRIC CO	36,697	82.300	3,020,163.10
FASTENAL CO	37,051	47.920	1,775,483.92
FORTIVE CORP	21,981	64.080	1,408,542.48
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	7,166	59.870	429,028.42
GENERAC HOLDINGS INC	3,973	212.500	844,262.50
GENERAL DYNAMICS CORP	14,867	230.730	3,430,262.91
GENERAL ELECTRIC CO	67,280	70.030	4,711,618.40
HEICO CORP	3,085	154.490	476,601.65
HEICO CORP-CLASS A	4,570	123.320	563,572.40
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	42,513	179.970	7,651,064.61
HOWMET AEROSPACE INC	23,889	35.320	843,759.48
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,107	232.870	490,657.09

IDEX CORP	4,788	208.040	996,095.52
ILLINOIS TOOL WORKS	19,622	198.630	3,897,517.86
INGERSOLL-RAND INC	25,011	49.600	1,240,545.60
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	11,600	54.060	627,096.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	42,895	56.290	2,414,559.55
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	11,965	233.960	2,799,331.40
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,104	250.300	526,631.20
LOCKHEED MARTIN CORP	14,923	416.630	6,217,369.49
MASCO CORP	14,885	48.640	724,006.40
NORDSON CORP	2,884	226.720	653,860.48
NORTHROP GRUMMAN CORP	9,085	484.880	4,405,134.80
OTIS WORLDWIDE CORP	25,348	69.850	1,770,557.80
OWENS CORNING	5,205	83.610	435,190.05
PACCAR INC	21,897	86.390	1,891,681.83
PARKER HANNIFIN CORP	8,047	270.770	2,178,886.19
PENTAIR PLC	8,220	44.420	365,132.40
PLUG POWER INC	28,584	29.590	845,800.56
QUANTA SERVICES INC	8,891	142.370	1,265,811.67
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	93,088	86.400	8,042,803.20
ROCKWELL AUTOMATION INC	7,031	250.990	1,764,710.69
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	7,600	41.080	312,208.00
SMITH (A.O.) CORP	7,157	52.270	374,096.39
SNAP-ON INC	3,106	216.730	673,163.38
STANLEY BLACK & DECKER INC	9,129	86.530	789,932.37
TEXTRON INC	11,803	64.000	755,392.00
TRANE TECHNOLOGIES PLC	14,363	160.170	2,300,521.71
TRANSDIGM GROUP INC	3,374	600.140	2,024,872.36
UNITED RENTALS INC	4,113	290.000	1,192,770.00
WABTEC CORP	11,284	89.270	1,007,322.68
WW GRAINGER INC	2,797	548.240	1,533,427.28
XYLEM INC	10,225	94.560	966,876.00
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	8,029	95.100	763,557.90
CINTAS CORP	5,707	402.890	2,299,293.23
CLARIVATE PLC	19,939	11.580	230,893.62
COPART INC	13,792	110.760	1,527,601.92
COSTAR GROUP INC	25,116	73.970	1,857,830.52
EQUIFAX INC	7,922	187.950	1,488,939.90
JACOBS SOLUTIONS INC	8,422	119.690	1,008,029.18
LEIDOS HOLDINGS INC	8,863	92.940	823,727.22
REPUBLIC SERVICES INC	14,232	145.960	2,077,302.72
ROBERT HALF INTL INC	5,555	78.660	436,956.30
ROLLINS INC	11,493	36.330	417,540.69
TRANSUNION	11,233	70.080	787,208.64
VERISK ANALYTICS INC	9,674	185.910	1,798,493.34

WASTE CONNECTIONS INC	16,122	146.680	2,364,774.96	
WASTE MANAGEMENT INC	25,212	171.730	4,329,656.76	
AMERCO	650	525.510	341,581.50	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,726	110.000	959,860.00	
CSX CORP	137,254	31.230	4,286,442.42	
DELTA AIR LINES INC	8,299	32.660	271,045.34	
EXPEDITORS INTL WASH INC	10,436	100.420	1,047,983.12	
FEDEX CORP	15,488	205.010	3,175,194.88	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	96,661	3.050	294,816.05	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,530	172.390	953,316.70	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	7,940	49.920	396,364.80	
LYFT INC-A	18,751	17.110	320,829.61	
NORFOLK SOUTHERN CORP	15,062	238.040	3,585,358.48	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	6,292	259.730	1,634,221.16	
SOUTHWEST AIRLINES CO	7,076	38.030	269,100.28	
UBER TECHNOLOGIES INC	89,549	33.050	2,959,594.45	
UNION PACIFIC CORP	38,617	217.950	8,416,575.15	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	45,848	190.960	8,755,134.08	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	6,249	31.530	197,030.97	
APTIV PLC	17,416	97.640	1,700,498.24	
BORGWARNER INC	12,075	37.080	447,741.00	
FORD MOTOR CO	237,633	14.660	3,483,699.78	
GENERAL MOTORS CO	87,113	40.620	3,538,530.06	
LEAR CORP	3,736	137.860	515,044.96	
LUCID GROUP INC	21,730	16.630	361,369.90	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	19,354	40.100	776,095.40	
TESLA INC	163,939	302.610	49,609,580.79	
DR HORTON INC	20,992	69.000	1,448,448.00	
GARMIN LTD	8,444	88.350	746,027.40	
HASBRO INC	7,491	80.570	603,549.87	
LENNAR CORP-A	17,126	73.440	1,257,733.44	
LULULEMON ATHLETICA INC	7,214	342.920	2,473,824.88	
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	100.600	288,017.80	
NEWELL BRANDS INC	26,997	16.990	458,679.03	
NIKE INC -CL B	79,035	107.000	8,456,745.00	
NVR INC	173	4,035.830	698,198.59	
PULTEGROUP INC	13,075	38.910	508,748.25	
VF CORP	20,583	41.090	845,755.47	
WHIRLPOOL CORP	3,212	145.660	467,859.92	
AIRBNB INC-CLASS A	23,260	126.800	2,949,368.00	
ARAMARK	13,242	38.070	504,122.94	
BOOKING HOLDINGS INC	2,502	1,967.380	4,922,384.76	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	13,336	46.260	616,923.36	
CARNIVAL CORP	69,745	10.570	737,204.65	

CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,745	1,721.490	3,004,000.05
DARDEN RESTAURANTS INC	7,606	130.300	991,061.80
DOMINO'S PIZZA INC	2,121	340.280	721,733.88
EXPEDIA GROUP INC	10,081	110.190	1,110,825.39
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	17,462	134.830	2,354,401.46
LAS VEGAS SANDS CORP	23,449	38.150	894,579.35
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	16,807	162.540	2,731,809.78
MCDONALD'S CORP	45,922	255.720	11,743,173.84
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,198	34.020	755,175.96
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	11,890	48.940	581,896.60
STARBUCKS CORP	70,068	92.700	6,495,303.60
VAIL RESORTS INC	2,860	231.950	663,377.00
WYNN RESORTS LTD	7,730	60.690	469,133.70
YUM! BRANDS INC	18,046	114.820	2,072,041.72
ADVANCE AUTO PARTS INC	3,426	170.040	582,557.04
AMAZON.COM INC	567,204	128.550	72,914,074.20
AUTOZONE INC	1,212	2,133.010	2,585,208.12
BATH & BODY WORKS INC	15,400	38.310	589,974.00
BEST BUY CO INC	12,132	73.550	892,308.60
BURLINGTON STORES INC	3,391	137.730	467,042.43
CARMAX INC	10,366	85.400	885,256.40
CHEWY INC - CLASS A	3,969	35.790	142,050.51
DOLLAR GENERAL CORP	14,255	241.070	3,436,452.85
DOLLAR TREE INC	13,992	138.010	1,931,035.92
DOORDASH INC - A	11,627	64.530	750,290.31
EBAY INC	35,551	42.570	1,513,406.07
ETSY INC	7,168	111.230	797,296.64
GENUINE PARTS CO	8,711	156.290	1,361,442.19
HOME DEPOT INC	63,655	276.340	17,590,422.70
LKQ CORP	15,922	49.580	789,412.76
LOWE'S COS INC	40,032	192.390	7,701,756.48
MERCADOLIBRE INC	2,889	960.330	2,774,393.37
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3,967	689.430	2,734,968.81
POOL CORP	2,578	330.190	851,229.82
ROSS STORES INC	22,258	89.460	1,991,200.68
TARGET CORP	29,311	165.380	4,847,453.18
TJX COMPANIES INC	73,417	64.360	4,725,118.12
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,072	189.010	1,336,678.72
ULTA BEAUTY INC	3,287	426.150	1,400,755.05
WAYFAIR INC- CLASS A	3,756	50.040	187,950.24
COSTCO WHOLESALE CORP	27,292	508.000	13,864,336.00
KROGER CO	41,915	48.940	2,051,320.10
SYSCO CORP	31,126	79.410	2,471,715.66
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	46,212	34.770	1,606,791.24

WALMART INC	94,190	134.920	12,708,114.80	
ALTRIA GROUP INC	111,379	41.760	4,651,187.04	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	34,455	86.170	2,968,987.35	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	18,950	72.040	1,365,158.00	
BUNGE LTD	10,263	92.200	946,248.60	
CAMPBELL SOUP CO	12,945	47.340	612,816.30	
COCA-COLA CO/THE	256,502	60.790	15,592,756.58	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	13,260	47.940	635,684.40	
CONAGRA BRANDS INC	30,896	33.350	1,030,381.60	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	10,439	240.930	2,515,068.27	
GENERAL MILLS INC	37,327	74.420	2,777,875.34	
HERSHEY CO/THE	8,925	221.750	1,979,118.75	
HORMEL FOODS CORP	19,475	45.950	894,876.25	
JM SMUCKER CO/THE	6,647	139.040	924,198.88	
KELLOGG CO	15,843	70.510	1,117,089.93	
KEURIG DR PEPPER INC	46,903	37.740	1,770,119.22	
KRAFT HEINZ CO/THE	44,124	34.960	1,542,575.04	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	15,162	79.410	1,204,014.42	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	9,629	50.650	487,708.85	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	85,090	60.240	5,125,821.60	
MONSTER BEVERAGE CORP	23,823	88.930	2,118,579.39	
PEPSICO INC	86,152	168.680	14,532,119.36	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	96,941	93.700	9,083,371.70	
TYSON FOODS INC-CL A	16,951	72.290	1,225,387.79	
CHURCH & DWIGHT CO INC	14,330	77.540	1,111,148.20	
CLOROX COMPANY	7,384	141.630	1,045,795.92	
COLGATE-PALMOLIVE CO	50,068	76.060	3,808,172.08	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	14,245	246.140	3,506,264.30	
KIMBERLY-CLARK CORP	21,336	121.810	2,598,938.16	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	149,109	138.510	20,653,087.59	
ABBOTT LABORATORIES	108,918	105.780	11,521,346.04	
ABIOMED INC	2,731	264.330	721,885.23	
ALIGN TECHNOLOGY INC	4,914	246.740	1,212,480.36	
AMERISOURCEBERGEN CORP	10,249	140.110	1,435,987.39	
BAXTER INTERNATIONAL INC	30,726	59.110	1,816,213.86	
BECTON DICKINSON AND CO	17,445	258.950	4,517,382.75	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	89,631	42.070	3,770,776.17	
CARDINAL HEALTH INC	18,000	66.740	1,201,320.00	
CENTENE CORP	36,696	83.920	3,079,528.32	
CIGNA CORP	19,571	284.080	5,559,729.68	
COOPER COS INC/THE	2,771	302.900	839,335.90	
CVS HEALTH CORP	82,113	101.050	8,297,518.65	
DAVITA INC	4,138	90.860	375,978.68	
DENTSPLY SIRONA INC	11,864	32.560	386,291.84	

DEXCOM INC	23,299	90.570	2,110,190.43
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	39,084	94.120	3,678,586.08
ELEVANCE HEALTH INC	15,116	470.110	7,106,182.76
HCA HEALTHCARE INC	14,575	208.760	3,042,677.00
HENRY SCHEIN INC	7,559	72.060	544,701.54
HOLOGIC INC	16,591	67.990	1,128,022.09
HUMANA INC	8,018	458.850	3,679,059.30
IDEXX LABORATORIES INC	4,980	350.470	1,745,340.60
INSULET CORP	4,263	263.600	1,123,726.80
INTUITIVE SURGICAL INC	22,662	210.780	4,776,696.36
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	5,327	222.960	1,187,707.92
MASIMO CORP	2,941	150.670	443,120.47
MCKESSON CORP	8,861	341.400	3,025,145.40
MEDTRONIC PLC	81,515	90.620	7,386,889.30
MOLINA HEALTHCARE INC	3,428	336.090	1,152,116.52
NOVOCURE LTD	6,929	88.060	610,167.74
QUEST DIAGNOSTICS INC	6,814	123.990	844,867.86
RESMED INC	8,775	233.200	2,046,330.00
STERIS PLC	6,271	203.650	1,277,089.15
STRYKER CORP	21,514	226.190	4,866,251.66
TELADOC HEALTH INC	7,496	31.670	237,398.32
TELEFLEX INC	3,067	238.650	731,939.55
UNITEDHEALTH GROUP INC	58,276	509.770	29,707,356.52
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,203	97.470	409,666.41
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	8,342	174.190	1,453,092.98
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	13,599	116.410	1,583,059.59
ABBVIE INC	109,052	139.550	15,218,206.60
AGILENT TECHNOLOGIES INC	18,024	133.250	2,401,698.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,912	208.280	1,647,911.36
AMGEN INC	33,461	228.120	7,633,123.32
AVANTOR INC	37,382	23.460	876,981.72
BIOGEN INC	8,733	204.110	1,782,492.63
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	11,557	86.860	1,003,841.02
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,220	477.480	582,525.60
BIO-TECHNE CORP	2,551	319.670	815,478.17
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	133,211	70.470	9,387,379.17
CATALENT INC	10,797	91.900	992,244.30
CHARLES RIVER LABORATORIES	3,467	202.320	701,443.44
DANAHER CORP	43,000	281.730	12,114,390.00
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	20,811	15.430	321,113.73
ELI LILLY & CO	49,897	309.610	15,448,610.17
EXACT SCIENCES CORP	9,771	40.560	396,311.76
GILEAD SCIENCES INC	79,125	65.180	5,157,367.50
HORIZON THERAPEUTICS PLC	13,945	63.760	889,133.20

ILLUMINA INC	9,281	196.860	1,827,057.66
INCYTE CORP	11,842	68.420	810,229.64
IQVIA HOLDINGS INC	11,280	209.130	2,358,986.40
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,089	151.820	620,791.98
JOHNSON & JOHNSON	163,529	164.660	26,926,685.14
MERCK & CO. INC.	155,959	86.950	13,560,635.05
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,369	1,250.050	1,711,318.45
MODERNA INC	20,549	139.400	2,864,530.60
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,359	104.320	663,370.88
PERKINELMER INC	8,323	134.660	1,120,775.18
PFIZER INC	346,479	46.150	15,990,005.85
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,546	697.620	4,566,620.52
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	20,785	42.440	882,115.40
SEAGEN INC	8,954	143.670	1,286,421.18
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	73,873	8.940	660,424.62
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	24,095	558.130	13,448,142.35
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	16,159	284.860	4,603,052.74
VIATRIS INC	83,466	9.430	787,084.38
WATERS CORP	3,425	298.040	1,020,787.00
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	4,241	290.820	1,233,367.62
ZOETIS INC	29,434	160.230	4,716,209.82
BANK OF AMERICA CORP	447,882	33.870	15,169,763.34
CITIGROUP INC	120,748	48.430	5,847,825.64
CITIZENS FINANCIAL GROUP	30,366	36.900	1,120,505.40
FIFTH THIRD BANCORP	42,445	34.980	1,484,726.10
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	670	858.110	574,933.70
FIRST REPUBLIC BANK/CA	10,970	147.490	1,617,965.30
HUNTINGTON BANCSHARES INC	88,161	13.870	1,222,793.07
JPMORGAN CHASE & CO	181,762	116.120	21,106,203.44
KEYCORP	62,741	17.640	1,106,751.24
M & T BANK CORP	11,046	183.250	2,024,179.50
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	26,202	162.410	4,255,466.82
REGIONS FINANCIAL CORP	53,059	22.130	1,174,195.67
SIGNATURE BANK	4,335	177.270	768,465.45
SVB FINANCIAL GROUP	3,727	377.590	1,407,277.93
TRUIST FINANCIAL CORP	83,228	47.350	3,940,845.80
US BANCORP	86,383	45.100	3,895,873.30
WEBSTER FINANCIAL CORP	9,600	47.840	459,264.00
WELLS FARGO & CO	235,909	43.280	10,210,141.52
ALLY FINANCIAL INC	20,139	31.780	640,017.42
AMERICAN EXPRESS CO	39,319	156.300	6,145,559.70
AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,131	277.960	1,982,132.76
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	24,207	57.420	1,389,965.94
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	49,681	43.720	2,172,053.32



BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	79,448	278.420	22,119,912.16	
BLACKROCK INC	9,264	643.580	5,962,125.12	
BLACKSTONE INC	42,926	95.360	4,093,423.36	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	24,892	100.650	2,505,379.80	
CARLYLE GROUP INC/THE	10,094	31.620	319,172.28	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	7,323	121.420	889,158.66	
CME GROUP INC	21,983	191.300	4,205,347.90	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	7,252	78.700	570,732.40	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	16,425	99.050	1,626,896.25	
EQUITABLE HOLDINGS INC	22,820	29.900	682,318.00	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,377	448.860	1,066,940.22	
FRANKLIN RESOURCES INC	21,778	24.540	534,432.12	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	5,375	45.470	244,401.25	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	21,390	327.260	7,000,091.40	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	35,337	99.860	3,528,752.82	
INVESCO LTD	18,328	16.320	299,112.96	
KKR & CO INC	33,210	50.140	1,665,149.40	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	4,992	232.880	1,162,536.96	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,653	262.930	697,553.29	
MOODY'S CORP	10,511	286.210	3,008,353.31	
MORGAN STANLEY	81,229	87.180	7,081,544.22	
MSCI INC	5,079	469.110	2,382,609.69	
NASDAQ INC	22,924	62.030	1,421,975.72	
NORTHERN TRUST CORP	13,026	94.670	1,233,171.42	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	11,520	107.250	1,235,520.00	
S&P GLOBAL INC	21,747	351.160	7,636,676.52	
SCHWAB (CHARLES) CORP	91,282	72.750	6,640,765.50	
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,481	55.390	303,592.59	
STATE STREET CORP	24,045	71.400	1,716,813.00	
SYNCHRONY FINANCIAL	32,112	31.740	1,019,234.88	
T ROWE PRICE GROUP INC	13,663	114.420	1,563,320.46	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	5,220	65.260	340,657.20	
AFLAC INC	37,779	60.130	2,271,651.27	
ALLEGHANY CORP	912	842.190	768,077.28	
ALLSTATE CORP	16,419	124.000	2,035,956.00	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,866	130.770	636,326.82	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	50,566	54.200	2,740,677.20	
AON PLC-CLASS A	13,151	283.770	3,731,859.27	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	25,320	47.020	1,190,546.40	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	13,030	185.100	2,411,853.00	
ASSURANT INC	3,114	155.920	485,534.88	
BROWN & BROWN INC	14,273	62.520	892,347.96	
CHUBB LTD	26,038	193.260	5,032,103.88	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	8,520	100.200	853,704.00	

ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,288	223.240	287,533.12	
EVEREST RE GROUP LTD	2,065	280.150	578,509.75	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	13,937	39.560	551,347.72	
GLOBE LIFE INC	6,373	101.170	644,756.41	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	21,767	65.660	1,429,221.22	
LINCOLN NATIONAL CORP	8,677	49.010	425,259.77	
LOEWS CORP	12,727	55.370	704,693.99	
MARKEL CORP	837	1,190.340	996,314.58	
MARSH & MCLENNAN COS	30,733	158.810	4,880,707.73	
METLIFE INC	41,426	66.410	2,751,100.66	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	16,409	77.580	1,273,010.22	
PROGRESSIVE CORP	36,619	128.040	4,688,696.76	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	22,933	94.080	2,157,536.64	
TRAVELERS COS INC/THE	15,031	163.240	2,453,660.44	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,823	207.000	1,412,361.00	
WR BERKLEY CORP	14,486	67.300	974,907.80	
CBRE GROUP INC - A	20,793	78.140	1,624,765.02	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	79,100	4.830	382,053.00	
ZILLOW GROUP INC - C	10,672	35.660	380,563.52	
ACCENTURE PLC-CL A	39,035	278.530	10,872,418.55	
ADOBE INC	29,039	371.520	10,788,569.28	
AFFIRM HOLDINGS INC	9,077	24.330	220,843.41	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	10,300	89.390	920,717.00	
ANSYS INC	4,983	247.000	1,230,801.00	
APPLOVIN CORP-CLASS A	8,926	25.340	226,184.84	
AUTODESK INC	13,358	208.520	2,785,410.16	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	25,601	234.480	6,002,922.48	
AVALARA INC	4,319	92.690	400,328.11	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	11,682	35.240	411,673.68	
BILL.COM HOLDINGS INC	6,004	163.120	979,372.48	
BLACK KNIGHT INC	10,656	68.300	727,804.80	
BLOCK INC	31,499	68.560	2,159,571.44	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	7,244	166.760	1,208,009.44	
CADENCE DESIGN SYS INC	17,492	167.230	2,925,187.16	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	6,979	61.320	427,952.28	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	6,776	119.880	812,306.88	
CITRIX SYSTEMS INC	8,351	103.640	865,497.64	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	14,179	61.420	870,874.18	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	32,759	62.030	2,032,040.77	
COUPA SOFTWARE INC	3,490	69.950	244,125.50	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	13,021	184.110	2,397,296.31	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	2,300	151.570	348,611.00	
DATADOG INC - CLASS A	14,023	97.030	1,360,651.69	
DOCUSIGN INC	12,031	60.550	728,477.05	

DROPBOX INC-CLASS A	16,584	22.010	365,013.84	
DYNATRACE INC	9,587	39.770	381,274.99	
EPAM SYSTEMS INC	3,733	424.420	1,584,359.86	
FAIR ISAAC CORP	1,494	463.980	693,186.12	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	38,249	87.060	3,329,957.94	
FISERV INC	37,974	105.900	4,021,446.60	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,371	209.870	917,341.77	
FORTINET INC	43,392	51.940	2,253,780.48	
GARTNER INC	5,357	302.080	1,618,242.56	
GLOBAL PAYMENTS INC	18,157	132.460	2,405,076.22	
GODADDY INC - CLASS A	8,905	76.080	677,492.40	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	4,731	66.900	316,503.90	
HUBSPOT INC	2,561	305.410	782,155.01	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	56,397	127.690	7,201,332.93	
INTUIT INC	16,358	436.840	7,145,828.72	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,971	193.300	960,894.30	
MASTERCARD INC - A	53,491	325.850	17,430,042.35	
MICROSOFT CORP	440,399	252.220	111,077,435.78	
MONGODB INC	4,150	247.220	1,025,963.00	
NORTONLIFELOCK INC	31,347	21.530	674,900.91	
OKTA INC	10,337	60.800	628,489.60	
ORACLE CORP	100,364	72.120	7,238,251.68	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	98,735	7.630	753,348.05	
PALO ALTO NETWORKS INC	18,642	182.060	3,393,962.52	
PAYCHEX INC	20,831	121.150	2,523,675.65	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,007	364.040	1,094,668.28	
PAYPAL HOLDINGS INC	67,541	97.660	6,596,054.06	
PTC INC	7,295	117.150	854,609.25	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	3,992	44.840	179,001.28	
ROPER TECHNOLOGIES INC	6,685	396.190	2,648,530.15	
SALESFORCE INC	62,120	160.280	9,956,593.60	
SERVICENOW INC	12,197	457.490	5,580,005.53	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	13,250	197.980	2,623,235.00	
SPLUNK INC	9,792	96.910	948,942.72	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	14,487	53.920	781,139.04	
SYNOPSIS INC	9,383	323.370	3,034,180.71	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	28,906	63.610	1,838,710.66	
TWILIO INC - A	10,905	77.970	850,262.85	
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,406	368.540	886,707.24	
UNITY SOFTWARE INC	10,899	37.810	412,091.19	
VERISIGN INC	6,425	178.340	1,145,834.50	
VISA INC-CLASS A SHARES	101,644	199.410	20,268,830.04	
VMWARE INC-CLASS A	13,809	116.120	1,603,501.08	
WESTERN UNION CO	21,840	14.490	316,461.60	

WIX.COM LTD	3,194	73.310	234,152.14	
WORKDAY INC-CLASS A	12,069	160.130	1,932,608.97	
ZENDESK INC	8,763	76.700	672,122.10	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	13,927	79.590	1,108,449.93	
ZSCALER INC	4,551	182.980	832,741.98	
AMPHENOL CORP-CL A	37,896	73.930	2,801,651.28	
APPLE INC	1,002,446	155.310	155,689,888.26	
ARISTA NETWORKS INC	14,847	122.260	1,815,194.22	
ARROW ELECTRONICS INC	4,130	99.120	409,365.60	
CDW CORP/DE	8,621	172.040	1,483,156.84	
CISCO SYSTEMS INC	256,628	43.960	11,281,366.88	
COGNEX CORP	8,698	42.390	368,708.22	
CORNING INC	51,762	32.920	1,704,005.04	
DELL TECHNOLOGIES -C	18,797	38.130	716,729.61	
F5 INC	3,921	153.430	601,599.03	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	86,138	13.030	1,122,378.14	
HP INC	62,253	27.040	1,683,321.12	
JUNIPER NETWORKS INC	17,460	28.050	489,753.00	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	11,811	168.110	1,985,547.21	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	10,692	242.310	2,590,778.52	
NETAPP INC	13,273	70.260	932,560.98	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	11,800	63.220	745,996.00	
TE CONNECTIVITY LTD	19,805	126.030	2,496,024.15	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,844	380.210	1,081,317.24	
TRIMBLE INC	15,566	61.220	952,950.52	
WESTERN DIGITAL CORP	18,492	38.330	708,798.36	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	3,257	295.970	963,974.29	
ADVANCED MICRO DEVICES	101,383	77.450	7,852,113.35	
ANALOG DEVICES INC	31,941	150.250	4,799,135.25	
APPLIED MATERIALS INC	53,908	90.640	4,886,221.12	
BROADCOM INC	25,105	510.750	12,822,378.75	
ENPHASE ENERGY INC	8,302	320.620	2,661,787.24	
ENTEGRIS INC	9,961	95.150	947,789.15	
INTEL CORP	254,475	29.180	7,425,580.50	
KLA CORP	9,474	346.610	3,283,783.14	
LAM RESEARCH CORP	8,550	421.760	3,606,048.00	
MARVELL TECHNOLOGY INC	53,345	48.410	2,582,431.45	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	32,867	65.690	2,159,033.23	
MICRON TECHNOLOGY INC	68,578	53.110	3,642,177.58	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,887	429.710	1,240,572.77	
NVIDIA CORP	155,657	131.280	20,434,650.96	
NXP SEMICONDUCTORS NV	16,594	159.450	2,645,913.30	
ON SEMICONDUCTOR	27,891	68.570	1,912,485.87	
QORVO INC	6,042	85.940	519,249.48	

QUALCOMM INC	69,691	127.530	8,887,693.23
SKYWORKS SOLUTIONS INC	10,677	100.010	1,067,806.77
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	3,319	322.700	1,071,041.30
TERADYNE INC	10,642	83.640	890,096.88
TEXAS INSTRUMENTS INC	57,116	165.260	9,438,990.16
AT&T INC	442,727	16.770	7,424,531.79
LIBERTY GLOBAL PLC- C	21,079	19.910	419,682.89
LIBERTY GLOBAL PLC-A	8,432	18.820	158,690.24
LUMEN TECHNOLOGIES INC	49,758	8.950	445,334.10
T-MOBILE US INC	39,441	141.930	5,597,861.13
VERIZON COMMUNICATIONS INC	259,035	41.280	10,692,964.80
AES CORP	41,893	27.030	1,132,367.79
ALLIANT ENERGY CORP	16,641	61.920	1,030,410.72
AMEREN CORPORATION	16,937	93.730	1,587,505.01
AMERICAN ELECTRIC POWER	31,824	103.320	3,288,055.68
AMERICAN WATER WORKS CO INC	11,721	153.480	1,798,939.08
ATMOS ENERGY CORP	8,726	117.030	1,021,203.78
CENTERPOINT ENERGY INC	37,091	32.750	1,214,730.25
CMS ENERGY CORP	16,996	68.690	1,167,455.24
CONSOLIDATED EDISON INC	22,160	99.970	2,215,335.20
CONSTELLATION ENERGY	20,234	88.050	1,781,603.70
DOMINION ENERGY INC	49,705	82.440	4,097,680.20
DTE ENERGY COMPANY	12,057	134.050	1,616,240.85
DUKE ENERGY CORP	46,960	109.270	5,131,319.20
EDISON INTERNATIONAL	24,655	69.490	1,713,275.95
ENTERGY CORP	12,677	118.710	1,504,886.67
ESSENTIAL UTILITIES INC	13,909	47.020	654,001.18
EVERGY INC	13,333	69.630	928,376.79
EVERSOURCE ENERGY	22,116	90.690	2,005,700.04
EXELON CORP	59,385	44.350	2,633,724.75
FIRSTENERGY CORP	31,966	41.440	1,324,671.04
NEXTERA ENERGY INC	121,355	88.880	10,786,032.40
NISOURCE INC	25,829	29.860	771,253.94
NRG ENERGY INC	13,547	44.310	600,267.57
P G & E CORP	91,894	13.220	1,214,838.68
PPL CORP	47,199	29.620	1,398,034.38
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	29,861	67.270	2,008,749.47
SEMPRA ENERGY	19,900	173.700	3,456,630.00
SOUTHERN CO/THE	64,788	79.430	5,146,110.84
UGI CORP	15,256	38.460	586,745.76
VISTRA CORP	25,777	25.360	653,704.72
WEC ENERGY GROUP INC	19,774	104.440	2,065,196.56
XCEL ENERGY INC	33,565	75.310	2,527,780.15
ACTIVISION BLIZZARD INC	47,754	76.600	3,657,956.40

ALPHABET INC-CL A	372,562	105.000	39,119,010.00		
ALPHABET INC-CL C	349,001	105.870	36,948,735.87		
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	27,658	9.910	274,090.78		
AMC ENTERTAINMENT-PFD EQ UT	27,658	5.360	148,246.88		
CABLE ONE INC	388	1,075.100	417,138.80		
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,256	385.110	2,794,358.16		
COMCAST CORP-CLASS A	279,670	34.470	9,640,224.90		
DISH NETWORK CORP-A	12,937	17.180	222,257.66		
ELECTRONIC ARTS INC	16,640	126.920	2,111,948.80		
FOX CORP - CLASS A	16,962	33.520	568,566.24		
FOX CORP - CLASS B	8,773	31.030	272,226.19		
IAC INC	3,974	63.770	253,421.98		
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	26,027	27.590	718,084.93		
LIBERTY BROADBAND-C	8,196	94.190	771,981.24		
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	13,438	64.680	869,169.84		
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	4,141	41.490	171,810.09		
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	12,383	41.290	511,294.07		
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	11,080	92.250	1,022,130.00		
MATCH GROUP INC	17,799	58.650	1,043,911.35		
META PLATFORMS INC-CLASS A	142,089	151.470	21,522,220.83		
NETFLIX INC	27,620	224.120	6,190,194.40		
NEWS CORP - CLASS A	23,102	16.860	389,499.72		
OMNICOM GROUP	12,545	68.130	854,690.85		
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	40,964	21.920	897,930.88		
PINTEREST INC- CLASS A	38,300	24.760	948,308.00		
ROBLOX CORP -CLASS A	22,745	45.070	1,025,117.15		
ROKU INC	6,012	68.350	410,920.20		
SEA LTD-ADR	22,722	62.880	1,428,759.36		
SIRIUS XM HOLDINGS INC	56,550	6.010	339,865.50		
SNAP INC - A	64,099	11.520	738,420.48		
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	10,772	128.160	1,380,539.52		
TWITTER INC	42,474	41.900	1,779,660.60		
WALT DISNEY CO/THE	113,298	112.500	12,746,025.00		
WARNER BROS DISCOVERY INC	136,145	12.710	1,730,402.95		
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	15,382	44.900	690,651.80		
アメリカ・ドル小計	21,157,741		2,122,722,020.78 (304,270,974,460)		
カナダ・ドル	ARC RESOURCES LTD	44,923	19.390	871,056.97	
	CAMECO CORP	26,627	40.100	1,067,742.70	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	72,331	73.870	5,343,090.97	
	CENOVUS ENERGY INC	85,669	25.570	2,190,556.33	
	ENBRIDGE INC	127,550	55.580	7,089,229.00	
	IMPERIAL OIL LTD	12,999	63.950	831,286.05	
	KEYERA CORP	11,374	32.000	363,968.00	

PARKLAND CORP	7,666	32.190	246,768.54
PEMBINA PIPELINE CORP	32,172	47.570	1,530,422.04
SUNCOR ENERGY INC	88,397	42.380	3,746,264.86
TC ENERGY CORP	61,897	63.810	3,949,647.57
TOURMALINE OIL CORP	20,401	84.190	1,717,560.19
AGNICO EAGLE MINES LTD	27,243	56.640	1,543,043.52
BARRICK GOLD CORP	114,792	20.520	2,355,531.84
CCL INDUSTRIES INC - CL B	8,705	67.120	584,279.60
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	41,452	23.550	976,194.60
FRANCO-NEVADA CORP	11,502	161.320	1,855,502.64
IVANHOE MINES LTD-CL A	32,698	9.020	294,935.96
KINROSS GOLD CORP	63,501	4.460	283,214.46
LUNDIN MINING CORP	46,446	7.030	326,515.38
NUTRIEN LTD	34,081	120.770	4,115,962.37
PAN AMERICAN SILVER CORP	11,763	21.130	248,552.19
TECK RESOURCES LTD-CLS B	29,836	44.310	1,322,033.16
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,438	112.370	498,698.06
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	26,168	43.030	1,126,009.04
CAE INC	17,963	23.470	421,591.61
TOROMONT INDUSTRIES LTD	6,027	103.520	623,915.04
WSP GLOBAL INC	7,668	164.560	1,261,846.08
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	9,913	39.600	392,554.80
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	5,667	86.730	491,498.91
THOMSON REUTERS CORP	11,370	147.720	1,679,576.40
AIR CANADA	12,083	18.720	226,193.76
CANADIAN NATL RAILWAY CO	36,438	157.890	5,753,195.82
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	58,152	101.610	5,908,824.72
TFI INTERNATIONAL INC	5,097	133.850	682,233.45
MAGNA INTERNATIONAL INC	16,331	74.400	1,215,026.40
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,082	97.600	300,803.20
GILDAN ACTIVEWEAR INC	11,302	42.770	483,386.54
RESTAURANT BRANDS INTERN	19,270	78.430	1,511,346.10
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	3,001	157.570	472,867.57
DOLLARAMA INC	17,025	76.700	1,305,817.50
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	52,906	59.060	3,124,628.36
EMPIRE CO LTD 'A'	9,148	37.790	345,702.92
LOBLAW COMPANIES LTD	9,797	114.740	1,124,107.78
METRO INC/CN	14,765	71.420	1,054,516.30
WESTON (GEORGE) LTD	4,984	150.620	750,690.08
SAPUTO INC	13,425	34.590	464,370.75
BANK OF MONTREAL	42,503	126.920	5,394,480.76
BANK OF NOVA SCOTIA	74,287	71.780	5,332,320.86
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	54,574	63.470	3,463,811.78
NATIONAL BANK OF CANADA	19,626	91.680	1,799,311.68

ROYAL BANK OF CANADA	87,727	126.980	11,139,574.46	
TORONTO-DOMINION BANK	113,800	87.610	9,970,018.00	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	88,140	65.460	5,769,644.40	
IGM FINANCIAL INC	4,949	36.850	182,370.65	
ONEX CORPORATION	4,217	68.080	287,093.36	
TMX GROUP LTD	3,142	132.370	415,906.54	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,393	648.890	903,903.77	
GREAT-WEST LIFECO INC	14,200	31.810	451,702.00	
IA FINANCIAL CORP INC	8,268	72.730	601,331.64	
INTACT FINANCIAL CORP	11,416	203.630	2,324,640.08	
MANULIFE FINANCIAL CORP	121,416	22.860	2,775,569.76	
POWER CORP OF CANADA	31,768	34.480	1,095,360.64	
SUN LIFE FINANCIAL INC	37,083	58.130	2,155,634.79	
FIRSTSERVICE CORP	2,516	164.540	413,982.64	
BLACKBERRY LTD	48,654	7.850	381,933.90	
CGI INC	13,476	103.540	1,395,305.04	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,234	1,986.220	2,450,995.48	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	6,363	25.230	160,538.49	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	5,042	42.580	214,688.36	
OPEN TEXT CORP	15,337	39.120	599,983.44	
SHOPIFY INC - CLASS A	70,950	44.360	3,147,342.00	
BCE INC	5,509	61.090	336,544.81	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	22,595	54.070	1,221,711.65	
TELUS CORP	15,222	28.540	434,435.88	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	44,154	17.770	784,616.58	
ALTAGAS LTD	17,347	29.570	512,950.79	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	6,336	53.230	337,265.28	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	7,344	40.650	298,533.60	
EMERA INC	18,000	62.210	1,119,780.00	
FORTIS INC	30,171	57.670	1,739,961.57	
HYDRO ONE LTD	18,821	35.490	667,957.29	
NORTHLAND POWER INC	15,741	44.890	706,613.49	
QUEBECOR INC -CL B	9,953	26.740	266,143.22	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	31,175	34.030	1,060,885.25	
カナダ・ドル小計	2,514,494		146,387,604.06 (15,934,290,702)	
オーストラ リア・ドル				
AMPOL LTD	14,428	32.090	462,994.52	
SANTOS LTD	199,921	7.690	1,537,392.49	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,722	25.600	325,683.20	
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	119,490	32.340	3,864,306.60	
BHP GROUP LTD	312,138	38.600	12,048,526.80	
BLUESCOPE STEEL LTD	37,214	16.630	618,868.82	
EVOLUTION MINING LTD	84,420	2.220	187,412.40	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	105,200	17.770	1,869,404.00	



JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	26,108	33.970	886,888.76	
MINERAL RESOURCES LTD	11,662	71.450	833,249.90	
NEWCREST MINING LTD	54,082	17.200	930,210.40	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	65,844	7.730	508,974.12	
ORICA LTD	36,212	14.460	523,625.52	
RIO TINTO LTD	22,751	94.830	2,157,477.33	
SOUTH32 LTD	276,348	4.320	1,193,823.36	
REECE LTD	13,059	15.060	196,668.54	
BRAMBLES LTD	86,089	12.000	1,033,068.00	
AURIZON HOLDINGS LTD	130,251	3.650	475,416.15	
QANTAS AIRWAYS LTD	45,831	5.230	239,696.13	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	37,719	34.010	1,282,823.19	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	3,794	65.940	250,176.36	
IDP EDUCATION LTD	10,940	28.210	308,617.40	
LOTTERY CORP LTD/THE	139,785	4.380	612,258.30	
WESFARMERS LTD	69,354	46.450	3,221,493.30	
COLES GROUP LTD	84,799	16.690	1,415,295.31	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	89,318	7.350	656,487.30	
WOOLWORTHS GROUP LTD	74,760	35.230	2,633,794.80	
TREASURY WINE ESTATES LTD	36,464	13.390	488,252.96	
COCHLEAR LTD	4,095	214.750	879,401.25	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	10,781	62.920	678,340.52	
SONIC HEALTHCARE LTD	31,126	32.440	1,009,727.44	
CSL LTD	30,041	289.630	8,700,774.83	
AUST AND NZ BANKING GROUP	183,288	22.950	4,206,459.60	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	107,036	94.460	10,110,620.56	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	198,227	29.350	5,817,962.45	
WESTPAC BANKING CORP	214,582	21.190	4,546,992.58	
ASX LTD	11,180	72.780	813,680.40	
MACQUARIE GROUP LTD	22,604	176.300	3,985,085.20	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	173,755	4.580	795,797.90	
MEDIBANK PRIVATE LTD	128,724	3.560	458,257.44	
QBE INSURANCE GROUP LTD	80,863	12.310	995,423.53	
SUNCORP GROUP LTD	88,234	10.750	948,515.50	
COMPUTERSHARE LTD	28,738	24.730	710,690.74	
WISETECH GLOBAL LTD	10,621	58.490	621,222.29	
XERO LTD	8,683	86.480	750,905.84	
TELSTRA CORP LTD	273,343	3.880	1,060,570.84	
ORIGIN ENERGY LTD	110,998	5.870	651,558.26	
REA GROUP LTD	2,833	124.090	351,546.97	
SEEK LTD	21,957	21.100	463,292.70	
オーストラリア・ドル小計	3,942,412		89,319,712.80 (8,632,750,242)	
香港・ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	173,424	48.050	8,333,023.20

TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	83,000	89.100	7,395,300.00		
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	94,000	13.980	1,314,120.00		
MTR CORP	84,500	40.150	3,392,675.00		
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	70,000	17.700	1,239,000.00		
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	149,000	43.250	6,444,250.00		
SANDS CHINA LTD	142,400	17.700	2,520,480.00		
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	117,000	14.480	1,694,160.00		
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	89,600	21.400	1,917,440.00		
WH GROUP LTD	561,000	5.380	3,018,180.00		
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	247,000	26.500	6,545,500.00		
HANG SENG BANK LTD	48,200	120.500	5,808,100.00		
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	73,800	300.600	22,184,280.00		
AIA GROUP LTD	733,800	71.500	52,466,700.00		
CK ASSET HOLDINGS LTD	126,924	52.300	6,638,125.20		
ESR GROUP LTD	157,000	21.850	3,430,450.00		
HANG LUNG PROPERTIES LTD	98,000	13.520	1,324,960.00		
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	83,384	24.850	2,072,092.40		
NEW WORLD DEVELOPMENT	84,833	26.150	2,218,382.95		
SINO LAND CO	248,200	11.300	2,804,660.00		
SUN HUNG KAI PROPERTIES	89,000	95.050	8,459,450.00		
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	27,000	55.100	1,487,700.00		
SWIRE PROPERTIES LTD	53,000	18.540	982,620.00		
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	91,000	36.950	3,362,450.00		
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	41,000	43.800	1,795,800.00		
CLP HOLDINGS LTD	94,100	65.000	6,116,500.00		
HONG KONG & CHINA GAS	606,389	7.260	4,402,384.14		
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	91,500	43.350	3,966,525.00		
香港・ドル小計	4,558,054		173,335,307.89 (3,165,102,722)		
シンガポ ール・ドル	KEPPEL CORP LTD	70,500	7.350	518,175.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	108,600	3.720	403,992.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	77,966	5.370	418,677.42	
	GENTING SINGAPORE LTD	327,500	0.785	257,087.50	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	130,000	3.990	518,700.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	109,800	33.320	3,658,536.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	211,400	12.220	2,583,308.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	75,600	27.280	2,062,368.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	65,200	9.650	629,180.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	176,200	3.700	651,940.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	25,800	8.440	217,752.00	
	UOL GROUP LTD	30,900	7.050	217,845.00	
	VENTURE CORP LTD	15,700	17.460	274,122.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	480,715	2.700	1,297,930.50	
シンガポール・ドル小計		1,905,881		13,709,613.42	

				(1,397,832,184)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	94,638	7.600	719,248.80	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	31,250	20.220	631,875.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	99,068	5.315	526,546.42	
	MERCURY NZ LTD	62,522	5.960	372,631.12	
	MERIDIAN ENERGY LTD	66,454	5.075	337,254.05	
ニュージーランド・ドル小計		353,932		2,587,555.39 (222,866,146)	
イギリス・ポンド	BP PLC	1,196,677	4.623	5,532,237.77	
	SHELL PLC	463,201	23.410	10,843,535.41	
	ANGLO AMERICAN PLC	80,377	28.515	2,291,950.15	
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	11.645	226,367.15	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	7,838	67.460	528,751.48	
	GLENCORE PLC	622,741	4.938	3,075,095.05	
	JOHNSON MATTHEY PLC	10,074	19.440	195,838.56	
	MONDI PLC	33,905	14.505	491,792.02	
	RIO TINTO PLC	68,899	47.980	3,305,774.02	
	ASHTREAD GROUP PLC	26,131	42.770	1,117,622.87	
	BAE SYSTEMS PLC	187,435	7.714	1,445,873.59	
	BUNZL PLC	22,658	28.100	636,689.80	
	DCC PLC	5,954	48.960	291,507.84	
	FERGUSON PLC	13,361	99.340	1,327,281.74	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	305,227	1.167	356,199.90	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	494,144	0.751	371,102.14	
	SMITHS GROUP PLC	24,369	15.190	370,165.11	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	4,459	106.000	472,654.00	
	EXPERIAN PLC	54,749	27.220	1,490,267.78	
	INTERTEK GROUP PLC	11,884	39.650	471,200.60	
	RELX PLC	121,421	22.530	2,735,615.13	
	RENTOKIL INITIAL PLC	112,603	5.364	604,002.49	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,766	4.064	263,209.02	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,637	34.750	230,635.75	
	BURBERRY GROUP PLC	26,233	17.720	464,848.76	
	PERSIMMON PLC	16,916	14.210	240,376.36	
	TAYLOR WIMPEY PLC	225,588	1.036	233,709.16	
	COMPASS GROUP PLC	110,016	19.070	2,098,005.12	
	ENTAIN PLC	42,158	12.020	506,739.16	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	11,820	48.130	568,896.60	
WHITBREAD PLC	11,282	26.690	301,116.58		
JD SPORTS FASHION PLC	144,300	1.259	181,673.70		
KINGFISHER PLC	109,678	2.439	267,504.64		
NEXT PLC	9,030	58.020	523,920.60		
OCADO GROUP PLC	27,379	6.232	170,625.92		
SAINSBURY (J) PLC	113,480	2.029	230,250.92		

TESCO PLC	495,919	2.373	1,176,815.78	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	24,258	13.285	322,267.53	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	132,652	34.055	4,517,463.86	
COCA-COLA HBC AG-DI	8,704	19.430	169,118.72	
DIAGEO PLC	140,860	37.635	5,301,266.10	
IMPERIAL BRANDS PLC	59,422	19.020	1,130,206.44	
HALEON PLC	293,573	2.703	793,527.81	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	44,920	64.540	2,899,136.80	
UNILEVER PLC	158,053	39.655	6,267,591.71	
NMC HEALTH PLC	3,940	0.010	39.40	
SMITH & NEPHEW PLC	57,278	10.640	609,437.92	
ASTRAZENECA PLC	95,562	101.520	9,701,454.24	
GSK PLC	249,255	13.322	3,320,575.11	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	14,590	12.420	181,207.80	
BARCLAYS PLC	1,083,154	1.699	1,840,278.64	
HSBC HOLDINGS PLC	1,255,233	5.189	6,513,404.03	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,324,726	0.462	1,998,023.41	
NATWEST GROUP PLC	347,420	2.697	936,991.74	
STANDARD CHARTERED PLC	172,614	6.124	1,057,088.13	
3I GROUP PLC	60,807	11.330	688,943.31	
ABRDN PLC	186,537	1.423	265,442.15	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	31,008	8.364	259,350.91	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	21,345	79.000	1,686,255.00	
M&G PLC	198,216	1.959	388,305.14	
SCHRODERS PLC	10,491	25.460	267,100.86	
ST JAMES'S PLACE PLC	33,823	10.900	368,670.70	
ADMIRAL GROUP PLC	11,535	21.980	253,539.30	
AVIVA PLC	174,060	4.373	761,164.38	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	386,391	2.598	1,003,843.81	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	59,286	6.034	357,731.72	
PRUDENTIAL PLC	178,081	9.380	1,670,399.78	
AVEVA GROUP PLC	6,037	30.480	184,007.76	
SAGE GROUP PLC/THE	55,987	7.226	404,562.06	
HALMA PLC	24,375	20.640	503,100.00	
BT GROUP PLC	403,957	1.404	567,155.62	
VODAFONE GROUP PLC	1,639,544	1.071	1,755,951.62	
NATIONAL GRID PLC	224,329	10.535	2,363,306.01	
SEVERN TRENT PLC	14,904	26.840	400,023.36	
SSE PLC	70,532	17.465	1,231,841.38	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	42,035	10.390	436,743.65	
AUTO TRADER GROUP PLC	51,319	6.228	319,614.73	
INFORMA PLC	102,755	5.488	563,919.44	
PEARSON PLC	39,623	9.042	358,271.16	
WPP PLC	78,503	7.566	593,953.69	

イギリス・ポンド小計		17,874,442		110,852,129.60 (18,322,748,503)	
イスラエル・シュケル	ICL GROUP LTD	41,773	30.070	1,256,114.11	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,389	690.700	959,382.30	
	BANK HAPOALIM BM	84,682	32.800	2,777,569.60	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	92,639	34.080	3,157,137.12	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	85,339	19.590	1,671,791.01	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	9,249	133.300	1,232,891.70	
	AZRIELI GROUP LTD	2,140	267.700	572,878.00	
	NICE LTD	3,919	708.000	2,774,652.00	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	7,438	155.000	1,152,890.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	88,555	6.000	531,330.00	
イスラエル・シュケル小計		417,123		16,086,635.84 (672,786,545)	
スイス・フラン	CLARIANT AG-REG	10,101	17.670	178,484.67	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	356	644.000	229,264.00	
	GIVAUDAN-REG	568	3,010.000	1,709,680.00	
	HOLCIM LTD	35,246	45.140	1,591,004.44	
	SIG GROUP AG	22,269	23.040	513,077.76	
	SIKA AG-REG	9,291	214.700	1,994,777.70	
	ABB LTD-REG	103,720	26.970	2,797,328.40	
	GEBERIT AG-REG	2,322	437.400	1,015,642.80	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,766	157.800	278,674.80	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,132	162.500	346,450.00	
	VAT GROUP AG	1,436	230.400	330,854.40	
	ADECCO GROUP AG-REG	9,118	30.120	274,634.16	
	SGS SA-REG	374	2,268.000	848,232.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	3,570	218.900	781,473.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	32,770	106.000	3,473,620.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,716	228.400	391,934.40	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	2,516	42.700	107,433.20	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	216	1,946.000	420,336.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	59	10,040.000	592,360.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	6	102,800.000	616,800.00	
	NESTLE SA-REG	175,046	109.100	19,097,518.60	
	ALCON INC	31,165	65.380	2,037,567.70	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,269	240.000	784,560.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	7,044	100.750	709,683.00	
	BACHEM HOLDING AG	1,756	55.350	97,194.60	
	LONZA GROUP AG-REG	4,715	499.400	2,354,671.00	
	NOVARTIS AG-REG	135,349	78.090	10,569,403.41	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,740	387.600	674,424.00	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	43,193	322.000	13,908,146.00		
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	168,196	5.116	860,490.73		

	JULIUS BAER GROUP LTD	15,168	48.330	733,069.44	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,372	934.600	1,282,271.20	
	UBS GROUP AG-REG	221,255	16.100	3,562,205.50	
	BALOISE HOLDING AG - REG	2,475	139.800	346,005.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,834	516.400	947,077.60	
	SWISS RE AG	19,228	82.200	1,580,541.60	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	9,220	428.900	3,954,458.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	3,906	83.350	325,565.10	
	TEMENOS AG - REG	3,743	79.960	299,290.28	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	10,426	47.970	500,135.22	
	SWISSCOM AG-REG	1,709	495.200	846,296.80	
	スイス・フラン小計	1,101,361		83,962,636.51 (12,498,678,071)	
デンマーク・クローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	7,211	405.000	2,920,455.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	11,512	406.600	4,680,779.20	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	513	1,346.500	690,754.50	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	65,433	173.460	11,350,008.18	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	206	15,490.000	3,190,940.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	311	16,100.000	5,007,100.00	
	DSV A/S	11,417	1,053.500	12,027,809.50	
	PANDORA A/S	5,888	424.700	2,500,633.60	
	CARLSBERG AS-B	5,585	947.000	5,288,995.00	
	COLOPLAST-B	6,399	878.400	5,620,881.60	
	DEMANT A/S	8,178	222.800	1,822,058.40	
	GN STORE NORD A/S	6,484	207.500	1,345,430.00	
	GENMAB A/S	3,934	2,727.000	10,728,018.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	103,208	787.800	81,307,262.40	
	DANSKE BANK A/S	39,103	103.900	4,062,801.70	
TRYG A/S	24,975	168.700	4,213,282.50		
ORSTED A/S	12,090	732.100	8,851,089.00		
	デンマーク・クローネ小計	312,447		165,608,298.58 (3,184,647,582)	
ノルウェー・クローネ	AKER BP ASA	21,204	348.500	7,389,594.00	
	EQUINOR ASA	60,849	370.900	22,568,894.10	
	NORSK HYDRO ASA	87,753	65.800	5,774,147.40	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,005	415.200	3,738,876.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	4,176	319.800	1,335,484.80	
	MOWI ASA	23,318	192.000	4,477,056.00	
	ORKLA ASA	46,955	82.500	3,873,787.50	
	SALMAR ASA	4,188	632.500	2,648,910.00	
	DNB BANK ASA	61,691	179.950	11,101,295.45	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,412	206.600	2,357,719.20	
	TELENOR ASA	40,694	105.250	4,283,043.50	
	ADEVINTA ASA	15,540	79.700	1,238,538.00	
	ノルウェー・クローネ小計	386,785		70,787,345.95	

				(1,005,888,186)	
スウェーデン・クロナ	BOLIDEN AB	15,297	347.150	5,310,353.55	
	HOLMEN AB-B SHARES	7,024	450.200	3,162,204.80	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	34,370	151.450	5,205,336.50	
	ALFA LAVAL AB	18,697	289.100	5,405,302.70	
	ASSA ABLOY AB-B	62,454	218.400	13,639,953.60	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	169,730	109.280	18,548,094.40	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	89,280	98.010	8,750,332.80	
	EPIROC AB-A	44,746	164.100	7,342,818.60	
	EPIROC AB-B	19,836	145.900	2,894,072.40	
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	66.960	1,244,987.28	
	INDUTRADE AB	17,913	196.850	3,526,174.05	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,223	200.800	1,651,178.40	
	LIFCO AB-B SHS	15,149	172.400	2,611,687.60	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	89,271	110.800	9,891,226.80	
	SANDVIK AB	70,108	158.950	11,143,666.60	
	SKANSKA AB-B SHS	26,915	155.100	4,174,516.50	
	SKF AB-B SHARES	20,607	150.900	3,109,596.30	
	VOLVO AB-A SHS	13,283	174.400	2,316,555.20	
	VOLVO AB-B SHS	90,883	167.600	15,231,990.80	
	SECURITAS AB-B SHS	16,123	89.260	1,439,138.98	
	VOLVO CAR AB-B	38,628	59.410	2,294,889.48	
	ELECTROLUX AB-B	11,555	123.260	1,424,269.30	
	EVOLUTION AB	11,254	873.800	9,833,745.20	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	40,148	113.300	4,548,768.40	
	SWEDISH MATCH AB	103,037	109.350	11,267,095.95	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	36,076	231.700	8,358,809.20	
	GETINGE AB-B SHS	13,151	195.750	2,574,308.25	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	13,513	220.900	2,985,021.70	
	NORDEA BANK ABP	210,076	102.260	21,482,371.76	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	108,374	110.400	11,964,489.60	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	97,603	91.400	8,920,914.20	
	SWEDBANK AB - A SHARES	57,603	149.600	8,617,408.80	
	EQT AB	15,443	255.600	3,947,230.80	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	7,211	229.900	1,657,808.90		
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,642	228.100	2,427,440.20		
INVESTOR AB-A SHS	27,415	179.550	4,922,363.25		
INVESTOR AB-B SHS	111,744	171.180	19,128,337.92		
KINNEVIK AB - B	12,465	147.000	1,832,355.00		
LUNDBERGS AB-B SHS	6,081	428.400	2,605,100.40		
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	31,938	56.020	1,789,166.76		
SAGAX AB-B	14,721	221.800	3,265,117.80		
ERICSSON LM-B SHS	183,318	75.190	13,783,680.42		
HEXAGON AB-B SHS	117,010	113.200	13,245,532.00		

	TELE2 AB-B SHS	38,424	107.900	4,145,949.60	
	TELIA CO AB	187,675	35.500	6,662,462.50	
	EMBRACER GROUP AB	30,012	67.890	2,037,514.68	
	スウェーデン・クローナ小計	2,383,619		302,321,339.93 (4,048,082,742)	
ユーロ	ENI SPA	154,027	11.810	1,819,058.87	
	GALP ENERGIA SGPS SA	25,920	10.625	275,400.00	
	NESTE OYJ	26,563	44.970	1,194,538.11	
	OMV AG	8,389	40.880	342,942.32	
	REPSOL SA	96,457	12.850	1,239,472.45	
	TENARIS SA	25,963	14.245	369,842.93	
	TOTALENERGIES SE	151,954	51.260	7,789,162.04	
	AIR LIQUIDE SA	32,024	123.960	3,969,695.04	
	AKZO NOBEL N.V.	12,475	60.720	757,482.00	
	ARCELORMITTAL	37,054	21.915	812,038.41	
	ARKEMA	3,250	83.380	270,985.00	
	BASF SE	56,522	42.770	2,417,445.94	
	COVESTRO AG	11,797	30.290	357,331.13	
	CRH PLC	45,964	35.405	1,627,355.42	
	EVONIK INDUSTRIES AG	17,669	18.725	330,852.02	
	HEIDELBERGCEMENT AG	8,677	45.790	397,319.83	
	KONINKLIJKE DSM NV	10,433	123.500	1,288,475.50	
	OCI NV	6,000	38.800	232,800.00	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	17,189	33.240	571,362.36	
	SOLVAY SA	4,802	82.020	393,860.04	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	30,234	14.215	429,776.31	
	SYMRISE AG	8,404	101.400	852,165.60	
	UMICORE	13,160	31.180	410,328.80	
	UPM-KYMMENE OYJ	32,818	34.210	1,122,703.78	
	VOESTALPINE AG	7,382	19.700	145,425.40	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	13,189	22.990	303,215.11	
	AIRBUS SE	36,169	95.480	3,453,416.12	
	ALSTOM	17,665	20.450	361,249.25	
	BOUYGUES SA	17,123	30.170	516,600.91	
	BRENTAG SE	9,920	68.520	679,718.40	
	CNH INDUSTRIAL NV	68,766	12.250	842,383.50	
	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	29,471	40.805	1,202,564.15	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	29,358	25.440	746,867.52	
	DASSAULT AVIATION SA	1,720	129.400	222,568.00	
	EIFFAGE	4,989	90.920	453,599.88	
	FERROVIAL SA	31,613	25.170	795,699.21	
	GEA GROUP AG	8,178	33.740	275,925.72	
	IMCD NV	3,214	132.650	426,337.10	
	KINGSPAN GROUP PLC	9,597	57.540	552,211.38	
	KION GROUP AG	3,179	23.770	75,564.83	



KNORR-BREMSE AG	3,881	45.190	175,382.39
KONE OYJ-B	20,623	40.150	828,013.45
LEGRAND SA	16,852	72.180	1,216,377.36
MTU AERO ENGINES AG	2,957	163.850	484,504.45
PRYSMIAN SPA	17,186	31.840	547,202.24
RATIONAL AG	350	461.200	161,420.00
RHEINMETALL AG	2,899	147.600	427,892.40
SAFRAN SA	21,782	102.980	2,243,110.36
SCHNEIDER ELECTRIC SE	33,134	125.840	4,169,582.56
SIEMENS AG-REG	46,887	102.720	4,816,232.64
SIEMENS ENERGY AG	31,878	13.485	429,874.83
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	19,773	17.945	354,826.48
THALES SA	7,074	117.050	828,011.70
VINCI SA	34,050	94.770	3,226,918.50
WARTSILA OYJ ABP	26,753	7.788	208,352.36
BUREAU VERITAS SA	17,817	24.730	440,614.41
RANDSTAD NV	6,241	47.490	296,385.09
TELEPERFORMANCE	3,420	289.200	989,064.00
WOLTERS KLUWER	16,360	101.500	1,660,540.00
ADP	1,346	132.700	178,614.20
AENA SME SA	4,377	118.450	518,455.65
ATLANTIA SPA	26,501	22.850	605,547.85
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	33,148	6.090	201,871.32
DEUTSCHE POST AG-REG	62,178	36.065	2,242,449.57
GETLINK SE	30,428	17.745	539,944.86
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	20,347	74.650	1,518,903.55
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	3,679	69.750	256,610.25
CONTINENTAL AG	8,078	56.300	454,791.40
FERRARI NV	7,986	200.500	1,601,193.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	49,688	57.750	2,869,482.00
MICHELIN (CGDE)	45,659	24.050	1,098,098.95
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	10,089	67.700	683,025.30
RENAULT SA	14,764	30.610	451,926.04
STELLANTIS NV	139,238	13.666	1,902,826.50
VALEO	14,444	19.175	276,963.70
VOLKSWAGEN AG	1,960	198.200	388,472.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	11,844	150.340	1,780,626.96
ADIDAS AG	10,395	142.300	1,479,208.50
ESSILORLUXOTTICA	17,807	152.900	2,722,690.30
HERMES INTERNATIONAL	1,973	1,295.500	2,556,021.50
KERING	4,486	519.100	2,328,682.60
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	17,101	654.200	11,187,474.20
MONCLER SPA	12,209	45.270	552,701.43
PUMA SE	6,459	60.660	391,802.94

SEB SA	1,127	71.000	80,017.00
ACCOR SA	10,451	24.530	256,363.03
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	10,188	119.900	1,221,541.20
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,785	32.370	187,260.45
SODEXO SA	4,760	82.140	390,986.40
DELIVERY HERO SE	8,530	48.070	410,037.10
D' IETEREN GROUP	1,449	152.300	220,682.70
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	71,341	22.780	1,625,147.98
JUST EAT TAKEAWAY	9,307	17.378	161,737.04
PROSUS NV	51,027	59.430	3,032,534.61
ZALANDO SE	12,367	21.660	267,869.22
CARREFOUR SA	35,990	16.655	599,413.45
HELLOFRESH SE	9,790	25.150	246,218.50
JERONIMO MARTINS	20,863	22.880	477,345.44
KESKO OYJ-B SHS	20,250	20.910	423,427.50
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	64,661	27.900	1,804,041.90
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	52,478	48.975	2,570,110.05
DANONE	40,711	50.510	2,056,312.61
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	35,407	9.540	337,782.78
HEINEKEN HOLDING NV	6,168	72.000	444,096.00
HEINEKEN NV	16,091	91.240	1,468,142.84
JDE PEET'S NV	6,660	30.580	203,662.80
KERRY GROUP PLC-A	9,894	97.080	960,509.52
PERNOD RICARD SA	12,775	189.250	2,417,668.75
REMY COINTREAU	1,273	179.700	228,758.10
BEIERSDORF AG	6,813	103.800	707,189.40
HENKEL AG & CO KGAA	5,974	60.800	363,219.20
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	10,398	62.780	652,786.44
L'OREAL	15,195	344.800	5,239,236.00
AMPLIFON SPA	7,567	25.040	189,477.68
BIOMERIEUX	2,791	88.980	248,343.18
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,161	117.500	253,917.50
DIASORIN SPA	1,313	132.400	173,841.20
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	13,613	33.640	457,941.32
FRESENIUS SE & CO KGAA	23,254	25.280	587,861.12
KONINKLIJKE PHILIPS NV	52,727	17.346	914,602.54
SIEMENS HEALTHINEERS AG	16,426	47.260	776,292.76
ARGENX SE	3,503	390.400	1,367,571.20
BAYER AG-REG	60,149	53.730	3,231,805.77
EUROFINS SCIENTIFIC	9,270	66.880	619,977.60
GRIFOLS SA	15,169	12.185	184,834.26
IPSEN	1,498	102.100	152,945.80
MERCK KGAA	7,777	171.850	1,336,477.45
ORION OYJ-CLASS B	6,261	45.290	283,560.69

QIAGEN N.V.	15,665	45.070	706,021.55	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	8,068	40.100	323,526.80	
SANOFI	70,543	80.690	5,692,114.67	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,682	429.800	722,923.60	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,555	374.400	582,192.00	
UCB SA	7,782	69.940	544,273.08	
ABN AMRO BANK NV-CVA	28,787	10.300	296,506.10	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	420,232	4.878	2,049,891.69	
BANCO SANTANDER SA	1,046,474	2.585	2,705,135.29	
BNP PARIBAS	68,484	50.250	3,441,321.00	
CAIXABANK SA	245,314	3.425	840,200.45	
COMMERZBANK AG	60,640	7.788	472,264.32	
CREDIT AGRICOLE SA	73,102	9.680	707,627.36	
ERSTE GROUP BANK AG	23,071	25.750	594,078.25	
FINECOBANK SPA	43,093	12.710	547,712.03	
ING GROEP NV	229,641	9.610	2,206,850.01	
INTESA SANPAOLO	1,011,886	1.900	1,922,583.40	
KBC GROUP NV	14,910	52.680	785,458.80	
MEDIOBANCA SPA	47,708	8.554	408,094.23	
SOCIETE GENERALE SA	48,558	24.225	1,176,317.55	
UNICREDIT SPA	127,961	10.866	1,390,424.22	
AMUNDI SA	3,955	50.000	197,750.00	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	127,233	9.020	1,147,641.66	
DEUTSCHE BOERSE AG	11,916	172.350	2,053,722.60	
EURAZEO SE	1,792	57.400	102,860.80	
EURONEXT NV	5,502	69.780	383,929.56	
EXOR NV	6,204	64.300	398,917.20	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,914	75.040	443,786.56	
SOFINA	804	187.500	150,750.00	
WENDEL	1,082	77.050	83,368.10	
AEGON NV	127,748	4.630	591,473.24	
AGEAS	11,247	39.070	439,420.29	
ALLIANZ SE-REG	24,953	172.120	4,294,910.36	
ASSICURAZIONI GENERALI	64,729	15.325	991,971.92	
AXA SA	119,547	25.165	3,008,400.25	
HANNOVER RUECK SE	3,598	160.050	575,859.90	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	9,023	260.800	2,353,198.40	
NN GROUP NV	16,917	41.160	696,303.72	
POSTE ITALIANE SPA	34,720	8.336	289,425.92	
SAMPO OYJ-A SHS	29,843	46.270	1,380,835.61	
AROUNDTOWN SA	73,508	2.674	196,560.39	
LEG IMMOBILIEN SE	4,538	67.940	308,311.72	
VONOVIA SE	46,339	24.600	1,139,939.40	
ADYEN NV	1,394	1,413.600	1,970,558.40	

AMADEUS IT GROUP SA	26,736	52.060	1,391,876.16	
BECHTLE AG	4,305	40.750	175,428.75	
CAPGEMINI SE	10,453	178.300	1,863,769.90	
DASSAULT SYSTEMES SE	40,049	37.955	1,520,059.79	
EDENRED	14,650	51.060	748,029.00	
NEMETSCHEK SE	3,011	54.000	162,594.00	
NEXI SPA	30,853	8.820	272,123.46	
SAP SE	64,997	85.980	5,588,442.06	
WORLDLINE SA	16,677	45.670	761,638.59	
NOKIA OYJ	348,610	4.970	1,732,591.70	
ASM INTERNATIONAL NV	3,170	276.850	877,614.50	
ASML HOLDING NV	25,040	478.750	11,987,900.00	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	79,641	24.520	1,952,797.32	
STMICROELECTRONICS NV	43,538	35.865	1,561,490.37	
CELLNEX TELECOM SA	32,830	37.300	1,224,559.00	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	200,747	19.050	3,824,230.35	
ELISA OYJ	8,681	51.280	445,161.68	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,804	9.440	149,189.76	
KONINKLIJKE KPN NV	222,179	3.130	695,420.27	
ORANGE	127,798	10.138	1,295,616.12	
PROXIMUS	10,895	11.990	130,631.05	
TELECOM ITALIA SPA	696,355	0.204	142,056.42	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	79,654	2.525	201,126.35	
TELEFONICA SA	335,910	3.929	1,319,790.39	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,269	22.380	117,920.22	
ACCIONA SA	1,810	204.400	369,964.00	
E.ON SE	147,318	8.926	1,314,960.46	
EDF	32,658	11.990	391,569.42	
EDP RENOVAVEIS SA	17,764	24.770	440,014.28	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	170,355	4.956	844,279.38	
ELIA GROUP SA/NV	2,111	138.600	292,584.60	
ENAGAS SA	14,471	17.480	252,953.08	
ENDESA SA	14,104	17.175	242,236.20	
ENEL SPA	501,060	4.920	2,465,215.20	
ENGIE	117,899	13.076	1,541,647.32	
FORTUM OYJ	24,312	9.964	242,244.76	
IBERDROLA SA	365,401	10.610	3,876,904.61	
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,603	26.160	277,374.48	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	23,632	17.890	422,776.48	
RWE AG	38,604	41.460	1,600,521.84	
SNAM SPA	133,867	4.794	641,758.39	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA	75,662	7.128	539,318.73	
UNIPER SE	4,697	3.976	18,675.27	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	42,162	22.500	948,645.00	

VERBUND AG	4,072	94.000	382,768.00	
BOLLORE SE	69,288	4.760	329,810.88	
PUBLICIS GROUPE	13,301	51.960	691,119.96	
SCOUT24 SE	4,671	57.320	267,741.72	
UBISOFT ENTERTAINMENT	4,745	35.450	168,210.25	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	44,422	19.540	868,005.88	
VIVENDI SE	38,496	8.512	327,677.95	
ユーロ小計	11,489,580		253,668,426.00 (36,266,974,865)	
合計	68,397,871		409,623,622,949 (409,623,622,949)	

(注) 金額欄の( )内は、外貨建保有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	70.6%	74.3%
カナダ・ドル	株式	85銘柄	3.7%	3.9%
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%	4.5%
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%	3.1%
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	8.4%	8.9%

(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	1,485,398.27	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	20,093.00	726,161.02	
		AMERICAN TOWER CORP	27,941.00	7,036,102.62	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	90,010.00	576,964.10	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	9,096.00	1,865,407.68	
		BOSTON PROPERTIES INC	9,604.00	804,046.88	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,009.00	785,736.84	
		CROWN CASTLE INC	27,033.00	4,500,994.50	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	18,137.00	2,105,342.96	
		DUKE REALTY CORP	24,944.00	1,432,783.36	
		EQUINIX INC	5,560.00	3,484,340.80	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	11,186.00	801,812.48	
		EQUITY RESIDENTIAL	22,609.00	1,677,813.89	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,379.00	1,158,639.61			

	EXTRA SPACE STORAGE INC	8,530.00	1,634,774.50	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	17,613.00	856,520.19	
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	22,843.00	537,038.93	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	36,377.00	961,080.34	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	46,189.00	846,182.48	
	INVITATION HOMES INC	36,871.00	1,408,840.91	
	IRON MOUNTAIN INC	19,659.00	1,067,090.52	
	KIMCO REALTY CORP	35,169.00	732,218.58	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	31,858.00	439,321.82	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	6,678.00	1,119,900.60	
	PROLOGIS INC	46,056.00	5,576,460.48	
	PUBLIC STORAGE	9,559.00	3,103,616.12	
	REALTY INCOME CORP	36,686.00	2,399,631.26	
	REGENCY CENTERS CORP	9,608.00	565,911.20	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	6,447.00	2,038,670.34	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	20,565.00	2,057,116.95	
	SUN COMMUNITIES INC	7,129.00	1,112,052.71	
	UDR INC	20,610.00	941,258.70	
	VENTAS INC	23,363.00	1,131,236.46	
	VICI PROPERTIES INC	60,354.00	2,004,959.88	
	VORNADO REALTY TRUST	8,706.00	230,621.94	
	WELLTOWER INC	27,308.00	2,020,245.84	
	WEYERHAEUSER CO	47,220.00	1,495,929.60	
	WP CAREY INC	11,067.00	937,928.25	
	アメリカ・ドル小計	882,839.00	63,660,153.61 (9,125,046,418)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,971.00	174,406.32	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,441.00	148,373.54	
	カナダ・ドル小計	11,412.00	322,779.86 (35,134,588)	
オーストラリア・ドル	APA GROUP	75,718.00	812,454.14	
	DEXUS/AU	59,026.00	486,964.50	
	GOODMAN GROUP	106,251.00	1,985,831.19	
	GPT GROUP	121,221.00	497,006.10	
	LENDLEASE GROUP	36,263.00	361,179.48	
	MIRVAC GROUP	251,619.00	520,851.33	
	SCENTRE GROUP	350,311.00	980,870.80	
	STOCKLAND	127,393.00	439,505.85	
	TRANSURBAN GROUP	190,071.00	2,546,951.40	
	VICINITY CENTRES	241,241.00	458,357.90	
	オーストラリア・ドル小計	1,559,114.00	9,089,972.69 (878,545,860)	
香港・ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	193,500.00	1,170,675.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	276,000.00	2,859,360.00	

	LINK REIT	136,600.00	8,387,240.00	
	香港・ドル小計	606,100.00	12,417,275.00 (226,739,442)	
シンガ ポール・ ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	219,000.00	626,340.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	303,516.00	634,348.44	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	208,100.00	357,932.00	
	MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	112,400.00	214,684.00	
	シンガポール・ドル小計	843,016.00	1,833,304.44 (186,923,721)	
イギリ ス・ポン ド	BRITISH LAND CO PLC	49,008.00	199,070.49	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	39,861.00	246,899.03	
	SEGRO PLC	78,831.00	701,280.57	
	イギリス・ポンド小計	167,700.00	1,147,250.09 (189,628,967)	
ユーロ	COVIVIO	2,388.00	127,638.60	
	GECINA SA	3,082.00	271,986.50	
	KLEPIERRE	13,600.00	275,944.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	7,024.00	357,943.04	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	9,913.00	282,123.98	
	ユーロ小計	36,007.00	1,315,636.12 (188,096,496)	
投資証券合計			10,830,115,492 (10,830,115,492)	
合 計			10,830,115,492 (10,830,115,492)	

(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	2.1%	84.3%
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%	2.1%
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15日現在)

(2022年9月15日現在)

資産の部

流動資産		
預金	471,624,359	1,650,407,303
金銭信託	1,828,983,066	17,810,893
コール・ローン	558,985,152	458,895,456
株式	10,200,086,676	19,175,883,995
投資信託受益証券	590,846,517	1,198,512,937
投資証券	1,164,708,816	1,928,973,773
派生商品評価勘定	-	1,980,350
未収入金	142,789	101,309
未収配当金	17,783,334	49,940,617
前払金	54,729,605	-
差入委託証拠金	758,656,545	384,880,216
流動資産合計	15,646,546,859	24,867,386,849
資産合計	15,646,546,859	24,867,386,849
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	58,673,121	62,673,873
未払金	166,857	-
未払解約金	4,000,000	63,525,116
未払利息	1,443	-
その他未払費用	6,216	303
流動負債合計	62,847,637	126,199,292
負債合計	62,847,637	126,199,292
純資産の部		
元本等		
元本	9,098,817,572	14,441,656,895
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	6,484,881,650	10,299,530,662
元本等合計	15,583,699,222	24,741,187,557
純資産合計	15,583,699,222	24,741,187,557
負債純資産合計	15,646,546,859	24,867,386,849

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2021年9月16日 至 2022年9月15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15日現在)	(2022年9月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	9,098,817,572口	14,441,656,895口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.7127円 (1万口当たりの純資産額17,127円)	1口当たり純資産額 1.7132円 (1万口当たりの純資産額17,132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16日 至 2022年9月15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15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15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 2112	3,680,021,765	-	3,625,292,160	54,729,605
	小計	3,680,021,765	-	3,625,292,160	54,729,605
合計		3,680,021,765	-	3,625,292,160	54,729,605

(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	2,389,400,000	-	2,385,456,484	3,943,516
	小計	2,389,400,000	-	2,385,456,484	3,943,516
合計		2,389,400,000	-	2,385,456,484	3,943,516

(2022年9月15日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MSCI EMGMKT DEC22	2,518,219,338	-	2,455,743,882	62,475,456
	小計	2,518,219,338	-	2,455,743,882	62,475,456
合計		2,518,219,338	-	2,455,743,882	62,475,456

(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	375,000,012	-	376,781,945	1,781,933
	小計	375,000,012	-	376,781,945	1,781,933
	売建				
	トルコ・リラ	12	-	12	-
	小計	12	-	12	-
	合 計	375,000,024	-	376,781,957	1,781,933

## (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16日 至 2022年9月15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15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	7,467,831,585円
同期中における追加設定元本額	4,323,012,865円
同期中における一部解約元本額	2,692,026,878円
2021年9月15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	5,256,111,923円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	2,442,980,621円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	111,304,543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	59,398,612円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	3,375,282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	669,613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>	35,959,788円
合計	9,098,817,572円

(2022年9月15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	9,098,817,572円
同期中における追加設定元本額	7,180,273,933円
同期中における一部解約元本額	1,837,434,610円
2022年9月15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	7,997,187,830円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	2,875,270,430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	95,576,545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)	463,254,241円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	1,346,682,816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
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	14,441,656,895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	1.700	44,540.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	4,068	6.360	25,872.48	
	SOUTHERN COPPER CORP	2,096	46.860	98,218.56	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	10,416	27.240	283,731.84	

LI AUTO INC - ADR	13,478	26.670	359,458.26		
NIO INC - ADR	33,895	21.940	743,656.30		
XPENG INC - ADR	10,439	16.020	167,232.78		
H WORLD GROUP LTD-ADR	4,760	36.010	171,407.60		
TAL EDUCATION GROUP- ADR	11,121	5.540	61,610.34		
TRIP.COM GROUP LTD-ADR	13,447	25.940	348,815.18		
YUM CHINA HOLDINGS INC	10,389	49.810	517,476.09		
PINDUODUO INC-ADR	12,466	69.870	870,999.42		
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	10,692	10.620	113,549.04		
RLX TECHNOLOGY INC-ADR	10,343	1.300	13,445.90		
BEIGENE LTD-ADR	1,163	154.250	179,392.75		
HUTCHMED CHINA-ADR	1,444	13.230	19,104.12		
LEGEND BIOTECH CORP-ADR	1,201	43.490	52,231.49		
ZAI LAB LTD-ADR	2,172	49.170	106,797.24		
CREDICORP LTD	1,764	127.580	225,051.12		
360 DIGITECH INC	2,669	14.260	38,059.94		
LUFAX HOLDING LTD-ADR	18,837	3.660	68,943.42		
KE HOLDINGS INC-ADR	16,424	18.260	299,902.24		
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	27,780	0.841	23,362.98		
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	12,430	3.200	39,776.00		
DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	1,469	62.630	92,003.47		
AUTOHOME INC-ADR	2,090	33.810	70,662.90		
IQIYI INC-ADR	7,166	3.470	24,866.02		
JOYY INC-ADR	1,164	27.790	32,347.56		
KANZHUN LTD - ADR	4,491	22.320	100,239.12		
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	19,174	4.780	91,651.72		
WEIBO CORP-SPON ADR	1,472	17.900	26,348.80		
アメリカ・ドル小計	296,720		5,310,754.68 (761,243,576)		
香港・ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	51,000	7.390	376,890.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	38,000	8.330	316,540.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	646,000	3.510	2,267,460.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	83,500	25.700	2,145,950.00	
	CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	29,000	3.550	102,950.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	520,000	3.490	1,814,800.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	38,000	34.150	1,297,700.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	72,000	3.170	228,240.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	32,500	29.750	966,875.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	47,000	7.840	368,480.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	104,000	7.400	769,600.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	52,000	4.590	238,680.00	
	CMOC GROUP LTD-H	66,000	3.570	235,620.00	
	DONGYUE GROUP	43,000	8.690	373,670.00	
GANFENG LITHIUM CO LTD-H	8,400	66.600	559,440.00		

JIANGXI COPPER CO LTD-H	20,000	9.970	199,400.00	
MMG LTD	80,000	2.160	172,800.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	37,000	6.200	229,400.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	14,250	13.340	190,095.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	33,000	5.740	189,420.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	142,000	9.060	1,286,520.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	51,000	3.650	186,150.00	
BOC AVIATION LTD	6,100	60.150	366,915.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	54,000	3.220	173,880.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	44,500	15.340	682,630.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	23,000	8.790	202,170.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	104,000	4.340	451,360.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	42,000	9.270	389,340.00	
CITIC LTD	143,000	7.990	1,142,570.00	
CRRC CORP LTD - H	85,000	2.850	242,250.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	72,000	4.560	328,320.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	13,000	17.360	225,680.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	19,000	8.560	162,640.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	10,000	7.390	73,900.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	46,000	10.160	467,360.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	16,218	11.280	182,939.04	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	13,500	35.450	478,575.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	29,800	3.440	102,512.00	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	77,000	3.560	274,120.00	
AIR CHINA LTD-H	56,000	6.080	340,480.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	44,000	4.840	212,960.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	38,140	11.600	442,424.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	40,000	4.190	167,600.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	78,400	10.380	813,792.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	38,000	5.020	190,760.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	22,000	6.770	148,940.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	3,000	149.000	447,000.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	27,000	6.550	176,850.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	32,000	6.230	199,360.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	30,000	4.290	128,700.00	
BYD CO LTD-H	20,500	220.000	4,510,000.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	70,000	4.660	326,200.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	16,800	37.800	635,040.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	148,000	13.680	2,024,640.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	81,500	11.300	920,950.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	81,200	6.550	531,860.00	
MINTH GROUP LTD	22,000	22.300	490,600.00	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	34,000	14.140	480,760.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	30,800	93.250	2,872,100.00	

BOSIDENG INTL HLDGS LTD	72,000	4.060	292,320.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	56,600	25.900	1,465,940.00	
LI NING CO LTD	58,000	66.250	3,842,500.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	20,400	74.150	1,512,660.00	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	33,000	10.380	342,540.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	31,000	17.100	530,100.00	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	16,000	15.800	252,800.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	37,500	20.850	781,875.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	25,600	16.100	412,160.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	374,600	87.100	32,627,660.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	100,000	4.300	430,000.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	12,000	15.120	181,440.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	27,500	51.050	1,403,875.00	
JD.COM INC - CL A	53,435	223.600	11,948,066.00	
MEITUAN-CLASS B	108,900	173.800	18,926,820.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	13,500	20.100	271,350.00	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	11,800	18.500	218,300.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	49,000	6.320	309,680.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	16,500	34.700	572,550.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	2,700	118.800	320,760.00	
CHINA FEIHE LTD	98,000	5.900	578,200.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	80,000	33.100	2,648,000.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	42,000	52.950	2,223,900.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	51,000	3.480	177,480.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	44,800	43.100	1,930,880.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	44,000	12.580	553,520.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	48,000	13.660	655,680.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	16,000	71.100	1,137,600.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	28,000	6.500	182,000.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	129,000	5.260	678,540.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	9,000	17.660	158,940.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	15,000	36.050	540,750.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	9,000	19.020	171,180.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	8,400	45.650	383,460.00	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	49,500	4.760	235,620.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	15,700	15.420	242,094.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	67,200	10.700	719,040.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	16,600	11.320	187,912.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	33,200	16.000	531,200.00	
3SBIO INC	30,500	5.410	165,005.00	
CANSINO BIOLOGICS INC-H	2,600	53.000	137,800.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	27,000	10.700	288,900.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	86,000	3.200	275,200.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	228,800	7.600	1,738,880.00	



GENSCRIPT BIOTECH CORP	30,000	20.850	625,500.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	2,500	67.200	168,000.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	34,000	13.460	457,640.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	23,000	28.050	645,150.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	5,100	44.050	224,655.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	10,500	20.700	217,350.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	271,000	3.890	1,054,190.00	
WUXI APPTCC CO LTD-H	8,711	69.450	604,978.95	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	88,500	50.800	4,495,800.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	744,000	2.470	1,837,680.00	
BANK OF CHINA LTD-H	1,981,000	2.690	5,328,890.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	216,000	4.400	950,400.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	220,000	3.350	737,000.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	2,379,000	4.700	11,181,300.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	77,000	2.360	181,720.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	98,000	39.350	3,856,300.00	
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	131,100	2.430	318,573.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	1,406,000	3.830	5,384,980.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	196,000	4.760	932,960.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	188,000	1.020	191,760.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	86,500	4.230	365,895.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	32,000	13.200	422,400.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	48,000	15.460	742,080.00	
FAR EAST HORIZON LTD	28,000	5.840	163,520.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	27,200	10.600	288,320.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	60,800	4.990	303,392.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	32,400	10.260	332,424.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	189,000	11.140	2,105,460.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	65,000	16.320	1,060,800.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	35,400	7.780	275,412.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	21,700	17.020	369,334.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	174,000	2.430	422,820.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	170,000	8.850	1,504,500.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	157,500	45.900	7,229,250.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	14,900	22.450	334,505.00	
A-LIVING SMART CITY SERVICES	18,250	7.920	144,540.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	66,000	1.650	108,900.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	96,000	1.880	180,480.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	94,500	22.350	2,112,075.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	30,000	8.350	250,500.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	80,000	32.850	2,628,000.00	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	15,800	35.350	558,530.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	39,200	16.100	631,120.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	104,000	1.850	192,400.00	

COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	170,000	2.410	409,700.00
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	54,000	15.400	831,600.00
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	22,500	17.180	386,550.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	34,000	5.550	188,700.00
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	12,100	10.180	123,178.00
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	47,500	27.650	1,313,375.00
SEAZEN GROUP LTD	32,000	2.760	88,320.00
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	28.850	865,500.00
YUEXIU PROPERTY CO LTD	29,600	10.600	313,760.00
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	66,000	5.760	380,160.00
GDS HOLDINGS LTD-CL A	23,900	22.850	546,115.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	68,000	13.020	885,360.00
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	12,000	5.940	71,280.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	21,000	12.920	271,320.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	13,500	14.220	191,970.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	13,000	24.000	312,000.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	13,500	26.000	351,000.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	21,000	7.740	162,540.00
LENOVO GROUP LTD	178,000	6.150	1,094,700.00
SUNNY OPTICAL TECH	18,200	99.700	1,814,540.00
XIAOMI CORP-CLASS B	377,000	10.440	3,935,880.00
ZTE CORP-H	16,600	17.200	285,520.00
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	9,000	24.850	223,650.00
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	14,000	21.400	299,600.00
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	120,000	10.180	1,221,600.00
CHINA TOWER CORP LTD-H	1,108,000	0.950	1,052,600.00
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	10,500	24.900	261,450.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	100,000	1.940	194,000.00
CGN POWER CO LTD-H	229,000	1.880	430,520.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	79,600	11.260	896,296.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	87,000	12.400	1,078,800.00
CHINA POWER INTERNATIONAL	148,000	4.190	620,120.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	24,900	29.500	734,550.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	52,000	15.820	822,640.00
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	20,000	110.200	2,204,000.00
GUANGDONG INVESTMENT LTD	62,000	6.970	432,140.00
HUANENG POWER INTL INC-H	114,000	4.350	495,900.00
KUNLUN ENERGY CO LTD	106,000	6.370	675,220.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	260,000	0.590	153,400.00
BAIDU INC-CLASS A	54,350	128.400	6,978,540.00
BILIBILI INC-CLASS Z	4,880	144.400	704,672.00
CHINA LITERATURE LTD	12,200	28.650	349,530.00

	CHINA RUYI HOLDINGS LTD	96,000	2.040	195,840.00	
	KINGSOFT CORP LTD	20,200	23.000	464,600.00	
	KUAISHOU TECHNOLOGY	43,100	61.450	2,648,495.00	
	NETEASE INC	51,100	136.300	6,964,930.00	
	TENCENT HOLDINGS LTD	154,200	299.600	46,198,320.00	
	香港・ドル小計	20,338,934		283,280,508.99 (5,172,702,094)	
台湾・ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	24,000	81.400	1,953,600.00	
	ASIA CEMENT CORP	57,000	44.300	2,525,100.00	
	CHINA STEEL CORP	299,000	29.300	8,760,700.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	87,000	68.100	5,924,700.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	105,000	88.100	9,250,500.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	121,000	67.600	8,179,600.00	
	TAIWAN CEMENT	149,676	39.650	5,934,653.40	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	3,000	780.000	2,340,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	79,000	32.150	2,539,850.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	2,000	1,650.000	3,300,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	55,000	41.250	2,268,750.00	
	CHINA AIRLINES LTD	63,000	22.050	1,389,150.00	
	EVA AIRWAYS CORP	59,000	33.450	1,973,550.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	62,740	80.800	5,069,392.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	41,000	28.900	1,184,900.00	
	WAN HAI LINES LTD	14,605	79.100	1,155,255.50	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	43,000	71.800	3,087,400.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	44,000	37.700	1,658,800.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	4,000	466.500	1,866,000.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	10,640	175.000	1,862,000.00	
	GIANT MANUFACTURING	7,000	232.500	1,627,500.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	4,000	283.000	1,132,000.00	
	POU CHEN	54,000	30.200	1,630,800.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	7,000	596.000	4,172,000.00	
	MOMO.COM INC	1,200	646.000	775,200.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	13,000	281.500	3,659,500.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	119,000	67.000	7,973,000.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	99,741	17.400	1,735,493.40	
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	443,000	22.300	9,878,900.00	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	324,669	27.400	8,895,930.60	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	261,147	26.400	6,894,280.80	
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	218,970	22.900	5,014,413.00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	281,700	34.750	9,789,075.00		
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	252,737	18.000	4,549,266.00		
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	265,647	14.850	3,944,857.95		
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	242,108	27.050	6,549,021.40		
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	88,299	48.550	4,286,916.45		

CHAILEASE HOLDING CO LTD	33,836	196.500	6,648,774.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	246,284	20.200	4,974,936.80
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	200,000	42.850	8,570,000.00
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	381,196	13.100	4,993,667.60
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	179,000	56.700	10,149,300.00
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	323,432	8.570	2,771,812.24
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	24,180	59.000	1,426,620.00
ACCTON TECHNOLOGY CORP	12,000	286.500	3,438,000.00
ACER INC	61,000	21.850	1,332,850.00
ADVANTECH CO LTD	11,299	321.500	3,632,628.50
ASUSTEK COMPUTER INC	17,000	252.500	4,292,500.00
AUO CORP	202,000	17.050	3,444,100.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	18,000	171.000	3,078,000.00
COMPAL ELECTRONICS	88,000	22.550	1,984,400.00
DELTA ELECTRONICS INC	48,000	268.000	12,864,000.00
E INK HOLDINGS INC	22,000	242.500	5,335,000.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	307,800	107.500	33,088,500.00
INNOLUX CORP	268,000	11.950	3,202,600.00
INVENTEC CORP	72,000	23.000	1,656,000.00
LARGAN PRECISION CO LTD	2,480	1,940.000	4,811,200.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	49,000	67.000	3,283,000.00
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	14,000	120.000	1,680,000.00
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	6,000	229.500	1,377,000.00
PEGATRON CORP	53,000	63.400	3,360,200.00
QUANTA COMPUTER INC	70,000	79.200	5,544,000.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	28,000	56.700	1,587,600.00
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	31,000	135.500	4,200,500.00
WIWYNN CORP	2,000	786.000	1,572,000.00
WPG HOLDINGS LTD	33,520	51.500	1,726,280.00
YAGEO CORPORATION	11,198	325.000	3,639,350.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	14,000	116.500	1,631,000.00
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	83,000	82.700	6,864,100.00
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	500	833.000	416,500.00
EMEMORY TECHNOLOGY INC	2,000	1,390.000	2,780,000.00
GLOBALWAFERS CO LTD	5,000	455.000	2,275,000.00
MEDIATEK INC	37,000	615.000	22,755,000.00
NANYA TECHNOLOGY CORP	26,000	50.700	1,318,200.00
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	14,000	258.000	3,612,000.00
PARADE TECHNOLOGIES LTD	2,000	761.000	1,522,000.00
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	80,000	31.600	2,528,000.00
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	11,000	321.500	3,536,500.00
SILERGY CORP	8,800	516.000	4,540,800.00
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	608,000	480.000	291,840,000.00
UNITED MICROELECTRONICS CORP	292,000	40.150	11,723,800.00

	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	19,000	73.800	1,402,200.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	6,000	162.500	975,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	61,000	21.250	1,296,250.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	96,000	119.500	11,472,000.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	36,000	73.500	2,646,000.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	43,000	97.200	4,179,600.00	
	台湾・ドル小計	8,266,404		683,710,824.64 (3,148,488,347)	
エジプト・ポンド	EASTERN CO SAE	13,558	10.550	143,036.90	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BAN	37,184	39.110	1,454,266.24	
	EFG-HERMES HOLDING SAE	15,925	12.800	203,840.00	
	エジプト・ポンド小計	66,667		1,801,143.14 (13,307,206)	
トルコ・リラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	2,650	340.700	902,855.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	38,881	31.180	1,212,309.58	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	19,291	33.000	636,603.00	
	KOC HOLDING AS	15,538	50.100	778,453.80	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	39,792	26.540	1,056,079.68	
	TURK HAVA YOLLARI AO	13,066	74.300	970,803.80	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	1,688	355.900	600,759.20	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	12,175	119.900	1,459,782.50	
	AKBANK T.A.S.	70,766	14.190	1,004,169.54	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	27,103	27.700	750,753.10	
	TURKIYE IS BANKASI-C	86,259	10.170	877,254.03	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	27,080	24.440	661,835.20	
	トルコ・リラ小計	354,289		10,911,658.43 (85,733,991)	
メキシコ・ペソ	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	77,000	78.280	6,027,560.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	3,095	217.110	671,955.45	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	20,300	38.050	772,415.00	
	ALFA S.A.B.-A	83,900	13.150	1,103,285.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	11,100	74.900	831,390.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	8,900	289.150	2,573,435.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	4,780	434.750	2,078,105.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	5,105	137.530	702,090.65	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	131,500	73.060	9,607,390.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	10,900	139.380	1,519,242.00	
	GRUMA S.A.B.-B	5,050	218.990	1,105,899.50	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	32,900	72.650	2,390,185.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	31,900	28.340	904,046.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	65,300	129.430	8,451,779.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	53,100	32.180	1,708,758.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	697,100	17.000	11,850,700.00	
OPERADORA DE SITES MEX- A-1	30,400	18.150	551,760.00		
	メキシコ・ペソ小計	1,272,330		52,849,995.60	

				(379,441,828)	
フィリピン・ペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	42,090	56.200	2,365,458.00	
	AYALA CORPORATION	6,750	730.000	4,927,500.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	1,310	508.000	665,480.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	82,562	51.000	4,210,662.00	
	SM INVESTMENTS CORP	5,405	859.500	4,645,597.50	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	23,130	185.700	4,295,241.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	12,830	244.800	3,140,784.00	
	MONDE NISSIN CORP	155,700	15.000	2,335,500.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	17,230	125.500	2,162,365.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	49,227	96.800	4,765,173.60	
	BDO UNIBANK INC	52,070	125.100	6,513,957.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	38,980	52.350	2,040,603.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	110,900	3.790	420,311.00	
	AYALA LAND INC	198,000	28.400	5,623,200.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	284,800	36.050	10,267,040.00	
	CONVERGE INFORMATION AND COM	47,400	16.900	801,060.00	
	GLOBE TELECOM INC	620	2,170.000	1,345,400.00	
	PLDT INC	2,005	1,660.000	3,328,300.00	
	ACEN CORP	141,680	6.880	974,758.40	
MANILA ELECTRIC COMPANY	5,120	310.200	1,588,224.00		
フィリピン・ペソ小計		1,277,809		66,416,614.50 (166,718,986)	
チリ・ペソ	EMPRESAS COPEC SA	10,529	7,377.800	77,680,856.20	
	EMPRESAS CMPC SA	22,543	1,616.100	36,431,742.30	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	3,601	104,000.000	374,504,000.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	374,056	76.680	28,682,614.08	
	FALABELLA SA	15,911	2,200.000	35,004,200.00	
	CENCOSUD SA	40,071	1,320.000	52,893,720.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	1,586	4,970.000	7,882,420.00	
	BANCO DE CHILE	1,024,325	87.000	89,116,275.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	1,084	27,500.000	29,810,000.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	1,825,075	36.700	66,980,252.50	
	ENEL AMERICAS SA	600,505	103.000	61,852,015.00	
	ENEL CHILE SA	364,877	35.510	12,956,782.27	
チリ・ペソ小計		4,284,163		873,794,877.35 (136,116,271)	
コロンビア・ペソ	ECOPETROL SA	134,524	2,399.000	322,723,076.00	
	BANCOLOMBIA SA	5,994	33,210.000	199,060,740.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	12,217	31,060.000	379,460,020.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	8,110	17,980.000	145,817,800.00	
コロンビア・ペソ小計		160,845		1,047,061,636.00 (34,191,798)	
インド・ルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	21,390	336.150	7,190,248.50	
	COAL INDIA LTD	37,979	231.950	8,809,229.05	

HINDUSTAN PETROLEUM CORP	15,734	242.800	3,820,215.20
INDIAN OIL CORP LTD	66,526	71.800	4,776,566.80
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	62,021	133.200	8,261,197.20
PETRONET LNG LTD	18,486	215.300	3,980,035.80
RELIANCE INDUSTRIES LTD	75,244	2,588.350	194,757,807.40
ACC LTD	1,628	2,743.200	4,465,929.60
AMBUJA CEMENTS LTD	16,248	524.600	8,523,700.80
ASIAN PAINTS LTD	9,511	3,438.950	32,707,853.45
BERGER PAINTS INDIA LTD	6,933	657.850	4,560,874.05
GRASIM INDUSTRIES LTD	6,476	1,782.800	11,545,412.80
HINDALCO INDUSTRIES LTD	34,596	442.000	15,291,432.00
JINDAL STEEL & POWER LTD	8,561	457.150	3,913,661.15
JSW STEEL LTD	18,789	692.850	13,017,958.65
PI INDUSTRIES LTD	1,869	3,294.950	6,158,261.55
PIDILITE INDUSTRIES LTD	3,991	2,869.150	11,450,777.65
SHREE CEMENT LTD	295	24,131.350	7,118,748.25
SRF LTD	3,336	2,822.400	9,415,526.40
TATA STEEL LTD	180,637	109.150	19,716,528.55
ULTRATECH CEMENT LTD	2,491	6,875.750	17,127,493.25
UPL LTD	12,873	748.300	9,632,865.90
VEDANTA LTD	15,567	305.600	4,757,275.20
ADANI ENTERPRISES LTD	7,025	3,572.100	25,094,002.50
BHARAT ELECTRONICS LTD	30,032	335.900	10,087,748.80
HAVELLS INDIA LTD	5,714	1,368.700	7,820,751.80
LARSEN & TOUBRO LTD	17,309	1,953.900	33,820,055.10
SIEMENS LTD	1,495	3,108.600	4,647,357.00
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	6,819	712.850	4,860,924.15
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	13,018	947.850	12,339,111.30
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	6,593	768.250	5,065,072.25
INTERGLOBE AVIATION LTD	2,035	1,905.050	3,876,776.75
BAJAJ AUTO LTD	1,601	3,850.250	6,164,250.25
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	1,906	1,960.850	3,737,380.10
BHARAT FORGE LTD	5,374	778.450	4,183,390.30
EICHER MOTORS LTD	3,370	3,541.800	11,935,866.00
HERO MOTOCORP LTD	2,709	2,851.500	7,724,713.50
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	21,636	1,298.050	28,084,609.80
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,979	8,967.200	26,713,288.80
MRF LTD	47	86,071.700	4,045,369.90
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	33,404	128.200	4,282,392.80
TATA MOTORS LTD	40,931	450.200	18,427,136.20
PAGE INDUSTRIES LTD	151	48,311.900	7,295,096.90
TITAN CO LTD	8,754	2,700.600	23,641,052.40
JUBILANT FOODWORKS LTD	9,393	635.300	5,967,372.90
TRENT LTD	4,308	1,430.600	6,163,024.80

ZOMATO LTD	58,211	63.300	3,684,756.30
AVENUE SUPERMARTS LTD	3,992	4,478.250	17,877,174.00
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	2,672	3,747.000	10,011,984.00
ITC LTD	72,909	335.350	24,450,033.15
MARICO LTD	13,955	534.200	7,454,761.00
NESTLE INDIA LTD	832	19,108.750	15,898,480.00
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	13,630	840.250	11,452,607.50
UNITED SPIRITS LTD	7,165	852.800	6,110,312.00
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	2,569	1,626.400	4,178,221.60
DABUR INDIA LTD	16,354	567.000	9,272,718.00
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	10,773	929.150	10,009,732.95
HINDUSTAN UNILEVER LTD	20,515	2,571.400	52,752,271.00
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	2,481	4,427.600	10,984,875.60
AUROBINDO PHARMA LTD	6,499	552.200	3,588,747.80
BIOCON LTD	10,292	305.250	3,141,633.00
CIPLA LTD	11,934	1,059.950	12,649,443.30
DIVI'S LABORATORIES LTD	3,272	3,668.550	12,003,495.60
DR. REDDY'S LABORATORIES	2,872	4,214.150	12,103,038.80
LUPIN LTD	4,861	666.400	3,239,370.40
PIRAMAL PHARMA LTD	9,756	219.124	2,137,773.74
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	23,658	883.750	20,907,757.50
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	2,503	1,502.050	3,759,631.15
AU SMALL FINANCE BANK LTD	3,304	677.600	2,238,790.40
AXIS BANK LTD	56,886	803.050	45,682,302.30
BANDHAN BANK LTD	13,522	306.550	4,145,169.10
ICICI BANK LTD	127,560	918.100	117,112,836.00
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	13,704	1,954.700	26,787,208.80
STATE BANK OF INDIA	44,000	571.750	25,157,000.00
YES BANK LTD	277,899	17.250	4,793,757.75
BAJAJ FINANCE LTD	6,716	7,483.450	50,258,850.20
BAJAJ FINSERV LTD	9,410	1,805.350	16,988,343.50
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	10,122	794.850	8,045,471.70
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	42,746	2,453.350	104,870,899.10
MUTHOOT FINANCE LTD	2,968	1,041.600	3,091,468.80
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	4,949	957.850	4,740,399.65
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	4,668	1,334.650	6,230,146.20
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	23,440	576.350	13,509,644.00
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	5,930	1,245.300	7,384,629.00
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	7,542	578.450	4,362,669.90
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	11,098	1,303.300	14,464,023.40
DLF LTD	15,255	407.200	6,211,836.00
GODREJ PROPERTIES LTD	3,083	1,417.000	4,368,611.00
HCL TECHNOLOGIES LTD	26,758	932.000	24,938,456.00
INFOSYS LTD	83,406	1,475.400	123,057,212.40



	LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	1,236	4,618.350	5,708,280.60	
	MINDTREE LTD	1,384	3,276.500	4,534,676.00	
	MPHASIS LTD	1,773	2,089.650	3,704,949.45	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	22,550	3,120.400	70,365,020.00	
	TATA ELXSI LTD	844	8,914.700	7,524,006.80	
	TECH MAHINDRA LTD	14,379	1,114.700	16,028,271.30	
	WIPRO LTD	33,678	416.300	14,020,151.40	
	BHARTI AIRTEL LTD	55,035	783.350	43,111,667.25	
	INDUS TOWERS LTD	16,890	203.550	3,437,959.50	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	7,809	2,293.600	17,910,722.40	
	ADANI POWER LTD	19,015	384.550	7,312,218.25	
	ADANI TOTAL GAS LTD	6,778	3,564.400	24,159,503.20	
	ADANI TRANSMISSION LTD	7,036	3,978.150	27,990,263.40	
	GAIL INDIA LTD	48,927	91.700	4,486,605.90	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	6,611	429.650	2,840,416.15	
	NTPC LTD	95,615	172.350	16,479,245.25	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	77,378	232.550	17,994,253.90	
	TATA POWER CO LTD	35,446	241.500	8,560,209.00	
	INFO EDGE INDIA LTD	1,749	4,235.000	7,407,015.00	
	インド・ルピー小計	2,398,588		1,856,660,321.84 (3,379,121,786)	
インドネ シア・ル ピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBK P	354,800	4,010.000	1,422,748,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	38,700	34,000.000	1,315,800,000.00	
	ADARO MINERALS INDONESIA TBK	171,600	1,960.000	336,336,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	128,000	2,120.000	271,360,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	626,800	830.000	520,244,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	57,500	9,500.000	546,250,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	325,161	4,340.000	1,411,198,740.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	91,200	6,650.000	606,480,000.00	
	VALE INDONESIA TBK	52,100	6,750.000	351,675,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	516,000	7,150.000	3,689,400,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	410,100	2,250.000	922,725,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	175,400	5,600.000	982,240,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	10,800	23,675.000	255,690,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	71,100	8,525.000	606,127,500.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	87,700	6,225.000	545,932,500.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	182,700	4,630.000	845,901,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	520,000	1,795.000	933,400,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,382,000	8,500.000	11,747,000,000.00	
	BANK JAGO TBK PT	102,500	7,675.000	786,687,500.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	460,200	9,300.000	4,279,860,000.00	
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	183,900	8,900.000	1,636,710,000.00		
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	1,709,100	4,580.000	7,827,678,000.00		
SARANA MENARA NUSANTARA PT	516,500	1,195.000	617,217,500.00		

	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	1,229,700	4,480.000	5,509,056,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	118,900	2,850.000	338,865,000.00	
	インドネシア・ルピア小計	9,522,461		48,306,581,740.00 (468,573,843)	
ブラジ ル・レア ル	COSAN SA	29,988	18.690	560,475.72	
	PETRO RIO SA	17,400	28.410	494,334.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	91,700	34.680	3,180,156.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	117,400	31.120	3,653,488.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	17,600	13.350	234,960.00	
	BRASKEM SA-PREF A	4,000	28.860	115,440.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	14,600	13.010	189,946.00	
	GERDAU SA-PREF	29,900	22.800	681,720.00	
	SUZANO SA	19,315	44.470	858,938.05	
	VALE SA	98,688	67.000	6,612,096.00	
	WEG SA	41,360	30.620	1,266,443.20	
	CCR SA	32,700	13.770	450,279.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	18,930	63.880	1,209,248.40	
	RUMO SA	34,000	20.130	684,420.00	
	AMERICANAS SA	13,024	16.740	218,021.76	
	LOJAS RENNER S.A.	24,358	27.380	666,922.04	
	MAGAZINE LUIZA SA	74,900	4.470	334,803.00	
	VIBRA ENERGIA SA	28,680	18.510	530,866.80	
	ATACADAO SA	14,200	20.120	285,704.00	
	RAIA DROGASIL SA	24,200	22.700	549,340.00	
	AMBEV SA	116,500	15.380	1,791,770.00	
	BRF SA	15,000	15.570	233,550.00	
	JBS SA	18,400	27.920	513,728.00	
	NATURA & CO HOLDING SA	22,100	16.450	363,545.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	114,419	7.830	895,900.77	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	9,900	33.190	328,581.00	
	HYPERA SA	10,100	43.250	436,825.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	39,481	15.910	628,142.71	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	133,536	19.330	2,581,250.88	
	BANCO DO BRASIL S.A.	21,200	40.260	853,512.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	121,000	26.700	3,230,700.00	
	ITAUSA SA	114,369	9.360	1,070,493.84	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	153,600	12.780	1,963,008.00	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	17,300	28.120	486,476.00		
TOTVS SA	12,900	29.850	385,065.00		
TELEFONICA BRASIL S.A.	11,300	41.370	467,481.00		
TIM SA	18,200	12.330	224,406.00		
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	26,805	45.370	1,216,142.85		
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	5,700	47.220	269,154.00		
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	34,299	11.620	398,554.38		

	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	9,300	51.250	476,625.00	
	CPFL ENERGIA SA	4,800	34.300	164,640.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	4,250	39.690	168,682.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	22,800	24.740	564,072.00	
	ブラジル・リアル小計	1,804,202		42,489,907.90 (1,177,607,797)	
チェコ・ コルナ	KOMERCNI BANKA AS	1,821	681.500	1,241,011.50	
	MONETA MONEY BANK AS	4,790	77.100	369,309.00	
	CEZ AS	4,177	979.000	4,089,283.00	
	チェコ・コルナ小計	10,788		5,699,603.50 (33,281,695)	
韓国・ ウォン	HD HYUNDAI	1,340	58,800.000	78,792,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	1,368	189,000.000	258,552,000.00	
	S-OIL CORP	1,213	95,000.000	115,235,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	2,623	52,800.000	138,494,400.00	
	HYUNDAI STEEL CO	1,821	35,150.000	64,008,150.00	
	KOREA ZINC CO LTD	227	624,000.000	141,648,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	531	127,500.000	67,702,500.00	
	LG CHEM LTD	1,232	663,000.000	816,816,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	227	300,500.000	68,213,500.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	360	174,500.000	62,820,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	641	185,500.000	118,905,500.00	
	POSCO HOLDINGS INC	1,934	239,500.000	463,193,000.00	
	SK CHEMICALS CO LTD	144	105,000.000	15,120,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	526	79,500.000	41,817,000.00	
	SKC CO LTD	496	110,000.000	54,560,000.00	
	CJ CORP	498	75,100.000	37,399,800.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	1,293	32,350.000	41,828,550.00	
	DOOSAN ENERBILITY CO LTD	10,618	17,500.000	185,815,000.00	
	ECOPRO BM CO LTD	1,290	107,000.000	138,030,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	1,373	27,650.000	37,963,450.00	
	GS HOLDINGS	1,178	45,650.000	53,775,700.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	1,849	43,050.000	79,599,450.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	448	125,000.000	56,000,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,568	52,600.000	82,476,800.00	
	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	1,158	86,400.000	100,051,200.00	
	LG CORP	2,459	80,700.000	198,441,300.00	
	LG ENERGY SOLUTION	600	498,500.000	299,100,000.00	
	SAMSUNG C&T CORP	2,163	115,000.000	248,745,000.00	
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	4,316	22,300.000	96,246,800.00	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	14,496	5,590.000	81,032,640.00	
	SK INC	961	224,500.000	215,744,500.00	
	S-1 CORPORATION	219	56,200.000	12,307,800.00	
CJ LOGISTICS	235	112,500.000	26,437,500.00		

HMM CO LTD	7,125	20,750.000	147,843,750.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	524	170,000.000	89,080,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	4,701	26,000.000	122,226,000.00	
PAN OCEAN CO LTD	4,527	5,410.000	24,491,070.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	2,114	40,150.000	84,877,100.00	
HANON SYSTEMS	4,138	10,900.000	45,104,200.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	1,515	214,000.000	324,210,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	3,424	198,500.000	679,664,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	863	93,700.000	80,863,100.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	582	92,700.000	53,951,400.00	
KIA CORP	6,495	80,300.000	521,548,500.00	
COWAY CO LTD	1,284	56,700.000	72,802,800.00	
F&F CO LTD / NEW	502	147,500.000	74,045,000.00	
HLB INC	2,599	45,100.000	117,214,900.00	
LG ELECTRONICS INC	2,622	94,000.000	246,468,000.00	
KANGWON LAND INC	2,078	25,400.000	52,781,200.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	680	71,600.000	48,688,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	172	93,800.000	16,133,600.00	
BGF RETAIL CO LTD	193	159,000.000	30,687,000.00	
E-MART INC	516	93,600.000	48,297,600.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	174	389,500.000	67,773,000.00	
KT&G CORP	2,707	83,600.000	226,305,200.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	694	98,400.000	68,289,600.00	
AMOREPACIFIC CORP	808	119,500.000	96,556,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	473	33,550.000	15,869,150.00	
LG H&H	231	672,000.000	155,232,000.00	
LG H&H-PRF	35	361,500.000	12,652,500.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	2,295	68,200.000	156,519,000.00	
SD BIOSENSOR INC	604	32,450.000	19,599,800.00	
ALTEOGEN INC	735	56,800.000	41,748,000.00	
CELLTRION INC	2,486	180,000.000	447,480,000.00	
CELLTRION PHARM INC	347	70,600.000	24,498,200.00	
GREEN CROSS CORP	79	153,500.000	12,126,500.00	
HANMI PHARM CO LTD	171	291,500.000	49,846,500.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	452	828,000.000	374,256,000.00	
SEEGENE INC	713	30,100.000	21,461,300.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	657	69,700.000	45,792,900.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	550	107,000.000	58,850,000.00	
YUHAN CORP	1,226	55,600.000	68,165,600.00	
HANA FINANCIAL GROUP	7,294	38,450.000	280,454,300.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	5,467	9,650.000	52,756,550.00	
KAKAObANK CORP	2,498	26,250.000	65,572,500.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	9,657	49,800.000	480,918,600.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	11,380	35,400.000	402,852,000.00	

	WOORI FINANCIAL GROUP INC	13,459	11,550.000	155,451,450.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	873	55,000.000	48,015,000.00	
	MERITZ FINANCIAL GROUP INC	824	25,250.000	20,806,000.00	
	MERITZ SECURITIES CO LTD	5,528	4,595.000	25,401,160.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	8,457	6,590.000	55,731,630.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	2,376	9,840.000	23,379,840.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	1,312	33,450.000	43,886,400.00	
	DB INSURANCE CO LTD	912	58,700.000	53,534,400.00	
	MERITZ FIRE & MARINE INSURAN	969	35,150.000	34,060,350.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	759	192,500.000	146,107,500.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	2,148	64,900.000	139,405,200.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	942	123,500.000	116,337,000.00	
	ILJIN MATERIALS CO LTD	385	66,600.000	25,641,000.00	
	L&F CO LTD	576	235,400.000	135,590,400.00	
	LG DISPLAY CO LTD	4,881	15,200.000	74,191,200.00	
	LG INNOTEK CO LTD	382	348,000.000	132,936,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1,381	139,500.000	192,649,500.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	117,729	56,800.000	6,687,007,200.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	20,285	52,400.000	1,062,934,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	1,371	614,000.000	841,794,000.00	
	SK HYNIX INC	13,459	93,000.000	1,251,687,000.00	
	SK SQUARE CO LTD	2,713	42,650.000	115,709,450.00	
	LG UPLUS CORP	4,555	11,250.000	51,243,750.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	5,778	19,450.000	112,382,100.00	
	CHEIL WORLDWIDE INC	1,193	22,200.000	26,484,600.00	
	CJ ENM CO LTD	144	91,000.000	13,104,000.00	
	HYBE CO LTD	459	158,500.000	72,751,500.00	
	KAKAO CORP	7,811	68,100.000	531,929,100.00	
	KAKAO GAMES CORP	734	49,850.000	36,589,900.00	
	KRAFTON INC	650	238,500.000	155,025,000.00	
	NAVER CORP	3,280	230,000.000	754,400,000.00	
	NCSOFT CORP	406	372,500.000	151,235,000.00	
	NETMARBLE CORP	337	61,700.000	20,792,900.00	
	PEARL ABYSS CORP	498	55,400.000	27,589,200.00	
	韓国・ウォン小計	387,358		23,959,207,690.00 (2,465,402,471)	
マレーシ ア・リン ギット	DIALOG GROUP BHD	90,500	2.200	199,100.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	7,300	21.000	153,300.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	63,200	8.700	549,840.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	82,100	4.620	379,302.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	20,400	7.030	143,412.00	
	SIME DARBY BERHAD	47,100	2.210	104,091.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	14,700	5.990	88,053.00	
	MISC BHD	28,500	7.100	202,350.00	

GENTING BHD	60,200	4.500	270,900.00		
GENTING MALAYSIA BHD	73,100	2.880	210,528.00		
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	22.080	189,888.00		
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	1,500	130.700	196,050.00		
PPB GROUP BERHAD	13,340	16.460	219,576.40		
QL RESOURCES BHD	29,250	5.070	148,297.50		
SIME DARBY PLANTATION BHD	59,300	4.330	256,769.00		
HARTALEGA HOLDINGS BHD	37,700	1.640	61,828.00		
IHH HEALTHCARE BHD	41,700	6.200	258,540.00		
TOP GLOVE CORP BHD	97,900	0.785	76,851.50		
AMMB HOLDINGS BHD	39,300	4.050	159,165.00		
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	172,800	5.390	931,392.00		
HONG LEONG BANK BERHAD	16,000	20.700	331,200.00		
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	5,700	18.960	108,072.00		
MALAYAN BANKING BHD	122,000	8.850	1,079,700.00		
PUBLIC BANK BERHAD	366,600	4.440	1,627,704.00		
RHB BANK BHD	28,900	5.690	164,441.00		
INARI AMERTRON BHD	52,900	2.770	146,533.00		
AXIATA GROUP BERHAD	52,900	2.900	153,410.00		
DIGI.COM BHD	86,400	3.530	304,992.00		
MAXIS BHD	57,900	3.750	217,125.00		
TELEKOM MALAYSIA BHD	34,000	5.800	197,200.00		
PETRONAS GAS BHD	21,600	16.840	363,744.00		
TENAGA NASIONAL BHD	67,600	8.780	593,528.00		
マレーシア・リングgit小計	2,035,040		10,510,078.90 (332,609,314)		
南アフリ カ・ラン ド	EXXARO RESOURCES LTD	6,027	231.690	1,396,395.63	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	2,473	263.680	652,080.64	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	1,308	1,278.220	1,671,911.76	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	10,879	236.010	2,567,552.79	
	GOLD FIELDS LTD	22,932	139.160	3,191,217.12	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	11,645	38.040	442,975.80	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	20,959	198.000	4,149,882.00	
	KUMBA IRON ORE LTD	1,588	381.200	605,345.60	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	8,310	161.570	1,342,646.70	
	SASOL LTD	13,960	316.720	4,421,411.20	
	SIBANYE STILLWATER LTD	73,151	40.470	2,960,420.97	
	BIDVEST GROUP LTD	7,735	217.760	1,684,373.60	
	MR PRICE GROUP LTD	6,331	191.060	1,209,600.86	
	NASPERS LTD-N SHS	5,394	2,470.000	13,323,180.00	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	35,012	21.440	750,657.28	
THE FOSCHINI GROUP LTD	6,946	135.750	942,919.50		

	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	24,638	63.630	1,567,715.94	
	BID CORP LTD	8,268	311.110	2,572,257.48	
	CLICKS GROUP LTD	6,014	301.880	1,815,506.32	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	12,962	226.690	2,938,355.78	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	4,180	151.360	632,684.80	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	9,393	144.410	1,356,443.13	
	ABSA GROUP LTD	19,853	178.380	3,541,378.14	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	2,146	1,791.770	3,845,138.42	
	NEDBANK GROUP LTD	11,348	211.590	2,401,123.32	
	STANDARD BANK GROUP LTD	33,094	145.620	4,819,148.28	
	FIRSTRAND LTD	124,451	64.390	8,013,399.89	
	REINET INVESTMENTS SCA	2,879	294.000	846,426.00	
	REMGRO LTD	13,046	133.110	1,736,553.06	
	DISCOVERY LTD	12,309	109.510	1,347,958.59	
	OLD MUTUAL LTD	116,070	10.740	1,246,591.80	
	SANLAM LTD	43,917	54.860	2,409,286.62	
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	11,259	91.160	1,026,370.44	
	MTN GROUP LTD	42,837	132.710	5,684,898.27	
	VODACOM GROUP LTD	16,889	130.570	2,205,196.73	
	MULTICHOICE GROUP LTD	7,894	116.000	915,704.00	
	南アフリカ・ランド小計	758,097		92,234,708.46 (755,402,262)	
タイ・ パーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	34,300	164.500	5,642,350.00	
	PTT PCL-NVDR	252,400	36.750	9,275,700.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	24,800	56.000	1,388,800.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	35,700	42.000	1,499,400.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	61,700	45.750	2,822,775.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	27,300	56.250	1,535,625.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	19,200	346.000	6,643,200.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	105,600	73.250	7,735,200.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR	221,600	9.100	2,016,560.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	229,500	8.850	2,031,075.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	184,500	6.000	1,107,000.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	72,700	29.750	2,162,825.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	36,791	40.000	1,471,640.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	166,900	14.100	2,353,290.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	72,100	27.000	1,946,700.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	19,000	34.250	650,750.00	
	CP ALL PCL-NVDR	148,700	59.750	8,884,825.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	5,400	99.250	535,950.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	106,800	25.500	2,723,400.00	
	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	29.500	7,510,700.00	

	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	14,700	225.000	3,307,500.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	16,500	150.000	2,475,000.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	103,500	16.800	1,738,800.00	
	SCB X PCL-NVDR	23,400	110.000	2,574,000.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	43,300	18.000	779,400.00	
	JMT NETWORK SERVICES-NVDR	16,600	76.000	1,261,600.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	27,100	60.500	1,639,550.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	16,200	43.250	700,650.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	11,800	51.250	604,750.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	46,300	68.250	3,159,975.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	176,900	8.850	1,565,565.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	7,700	622.000	4,789,400.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	29,300	195.000	5,713,500.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	27,000	73.750	1,991,250.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	259,200	5.000	1,296,000.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	20,900	37.750	788,975.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	5,500	177.000	973,500.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	44,900	90.250	4,052,225.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	14,800	69.000	1,021,200.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	78,100	55.250	4,315,025.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	19,600	43.000	842,800.00	
	タイ・パーツ小計	3,180,191		117,711,905.00 (460,253,549)	
ポーランド・ズロチ	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	10,357	57.060	590,970.42	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	36,383	5.248	190,937.98	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	3,845	89.600	344,512.00	
	LPP SA	23	8,355.000	192,165.00	
	ALLEGRO.EU SA	10,674	25.450	271,653.30	
	DINO POLSKA SA	1,310	344.200	450,902.00	
	BANK PEKAO SA	3,856	70.280	270,999.68	
	MBANK SA	302	263.400	79,546.80	
	PKO BANK POLSKI SA	23,204	24.390	565,945.56	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	751	222.200	166,872.20	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	16,272	28.090	457,080.48	
	ORANGE POLSKA SA	15,737	5.790	91,117.23	
	PGE SA	19,508	6.906	134,722.24	
	CD PROJEKT SA	1,469	90.440	132,856.36	
CYFROWY POLSAT SA	5,742	19.360	111,165.12		
	ポーランド・ズロチ小計	149,433		4,051,446.37 (122,806,632)	
ハンガリー・フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	8,186	2,678.000	21,922,108.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	2,331	7,875.000	18,356,625.00	
	OTP BANK PLC	4,109	8,600.000	35,337,400.00	
	ハンガリー・フォリント小計	14,626		75,616,133.00	



		(26,659,678)		
ユーロ	MYTILINEOS S.A.	2,326	14.570	33,889.82
	FF GROUP	123	4.800	590.40
	OPAP SA	4,784	13.260	63,435.84
	JUMBO SA	2,851	13.520	38,545.52
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	53,592	0.891	47,750.47
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	64,000	0.895	57,280.00
	NATIONAL BANK OF GREECE	13,389	3.217	43,072.41
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	5,406	15.600	84,333.60
	PUBLIC POWER CORP	4,579	5.315	24,337.38
ユーロ小計		151,050		393,235.44 (56,220,871)
合計		56,729,995		19,175,883,995 (19,175,883,995)

(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%	4.0%
香港・ドル	株式	196銘柄	20.9%	27.0%
台湾・ドル	株式	87銘柄	12.7%	16.4%
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	0.3%	0.4%
メキシコ・ペソ	株式	17銘柄	1.5%	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	13.7%	17.6%
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	4.8%	6.1%
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%	12.9%
マレーシア・リングgit	株式	34銘柄	1.3%	1.7%
南アフリカ・ランド	株式	36銘柄	3.1%	3.9%
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	58,313,852.00	
	オフショア・人民元小計		1,403,800.00	58,313,852.00 (1,198,512,937)	

投資信託受益証券合計			1,198,512,937		
			(1,198,512,937)		
投資証券	アメリカ・ドル	ISHARES MSCI KUWAIT ETF	37,235.00	1,328,097.98	
		ISHARES MSCI QATAR ETF	82,108.00	1,820,662.79	
		ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	166,080.00	7,182,960.00	
		ISHARES MSCI UAE ETF	130,807.00	2,081,139.37	
	アメリカ・ドル小計		416,230.00	12,412,860.14	(1,779,259,371)
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB-CPO	393,600.00	2,975,616.00	
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	12,945.00	1,637,671.95	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	47,900.00	6,406,146.00	
		GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	54,100.00	1,339,516.00	
		TRUST FIBRA UNO	66,400.00	1,448,184.00	
	メキシコ・ペソ小計		574,945.00	13,807,133.95	(99,129,699)
	ブラジル・リアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	29,100.00	769,404.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	7,800.00	233,454.00	
		ENERGISA SA-UNITS	4,800.00	214,560.00	
		KLABIN SA - UNIT	17,500.00	330,925.00	
ブラジル・リアル小計		59,200.00	1,548,343.00	(42,912,326)	
南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	72,006.00	936,798.06		
	南アフリカ・ランド小計		72,006.00	936,798.06	(7,672,376)
投資証券合計			1,928,973,773	(1,928,973,773)	
合計			3,127,486,710	(3,127,486,710)	

(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%	56.9%
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	4.8%	-	38.3%
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15日現在 )	( 2022年9月15日現在 )
資産の部		
流動資産		
金銭信託	83,504,812	4,999,145
コール・ローン	25,521,259	128,802,353
投資証券	7,359,713,460	9,875,778,500
未収配当金	79,532,884	106,244,828
前払金	904,000	42,000
差入委託証拠金	1,500,000	2,380,000
流動資産合計	7,550,676,415	10,118,246,826
資産合計	7,550,676,415	10,118,246,826
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	908,400	116,400
未払金	67,492,386	100,230,115
未払解約金	5,320,521	2,573,041
未払利息	65	-
その他未払費用	117	142
流動負債合計	73,721,489	102,919,698
負債合計	73,721,489	102,919,698
純資産の部		
元本等		
元本	2,701,982,065	3,654,656,067
剰余金		
剰余金又は欠損金 ( )	4,774,972,861	6,360,671,061
元本等合計	7,476,954,926	10,015,327,128
純資産合計	7,476,954,926	10,015,327,128
負債純資産合計	7,550,676,415	10,118,246,826

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2021年9月16日 至 2022年9月15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15日現在)	(2022年9月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,701,982,065口	3,654,656,067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 2.7404円 (1万口当たりの純資産額27,404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16日 至 2022年9月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかると、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15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15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	-	42,060,000	908,400
	小計	42,968,400	-	42,060,000	908,400
合計		42,968,400	-	42,060,000	908,400

(2022年9月15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	-	40,030,000	116,400
	小計	40,146,400	-	40,030,000	116,400
合計		40,146,400	-	40,030,000	116,400

(注) 1. 時価の算定方法

リート指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2)リート指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2021年9月16日 至 2022年9月15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15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	3,147,959,475円
同期中における追加設定元本額	1,795,755,288円
同期中における一部解約元本額	2,241,732,698円
2021年9月15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)	76,612,726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	1,737,939,195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)	51,092,333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	18,246,810円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,619,034円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	44,595,253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	610,389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	2,701,982,065円

(2022年9月15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	2,701,982,065円
同期中における追加設定元本額	2,546,214,595円
同期中における一部解約元本額	1,593,540,593円
2022年9月15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	2,150,010,280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	29,390,097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	87,019,162円
日興FWS・Jリートインデックス	309,369,643円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	19,868,902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%)&lt;適

格機関投資家限定&gt;

151,444,083円

合計

3,654,656,067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	176	21,067,200	
	サンケイリアルエステート投資法人	279	27,593,100	
	S O S I L A 物流リート投資法人	414	64,252,800	
	東海道リート投資法人	104	12,781,600	
	日本アコモデーションファンド投資法人	304	204,896,000	
	森ヒルズリート投資法人	1,038	163,900,200	
	産業ファンド投資法人	1,321	234,081,200	
	アドバンス・レジデンス投資法人	883	316,555,500	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	635	140,970,000	
	アクティブ・プロパティーズ投資法人	466	205,506,000	
	G L P 投資法人	2,720	446,352,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	410	137,145,000	
	日本プロロジスリート投資法人	1,447	481,851,000	
	星野リゾート・リート投資法人	155	103,230,000	
	O n e リート投資法人	154	42,026,600	
	イオンリート投資法人	979	154,290,400	
	ヒューリックリート投資法人	828	141,008,400	
	日本リート投資法人	286	109,538,000	
	積水ハウス・リート投資法人	2,687	223,289,700	
	トーセイ・リート投資法人	194	27,354,000	
	ケネディクス商業リート投資法人	370	105,154,000	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	217	38,734,500	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	219	27,594,000	
	野村不動産マスターファンド投資法人	2,852	476,569,200	
いちごホテルリート投資法人	146	14,819,000		
ラサールロジポート投資法人	1,083	183,785,100		
スターアジア不動産投資法人	1,100	65,340,000		
マリモ地方創生リート投資法人	110	14,751,000		
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	349	182,178,000		
大江戸温泉リート投資法人	147	9,981,300		



投資法人みらい	1,078	55,085,800	
森トラスト・ホテルリート投資法人	210	28,329,000	
三菱地所物流リート投資法人	273	128,446,500	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	341	71,916,900	
ザイマックス・リート投資法人	144	18,273,600	
タカラレーベン不動産投資法人	388	41,554,800	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	344	53,492,000	
日本ビルファンド投資法人	1,030	692,160,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	882	568,008,000	
日本都市ファンド投資法人	4,450	484,160,000	
オリックス不動産投資法人	1,757	341,912,200	
日本プライムリアルティ投資法人	604	247,640,000	
N T T 都市開発リート投資法人	851	128,671,200	
東急リアル・エステート投資法人	591	117,845,400	
グローバル・ワン不動産投資法人	608	68,582,400	
ユナイテッド・アーバン投資法人	1,989	300,537,900	
森トラスト総合リート投資法人	632	91,892,800	
インヴィンシブル投資法人	3,885	175,990,500	
フロンティア不動産投資法人	328	176,136,000	
平和不動産リート投資法人	606	94,293,600	
日本ロジスティクスファンド投資法人	594	190,080,000	
福岡リート投資法人	456	77,702,400	
ケネディクス・オフィス投資法人	259	184,149,000	
いちごオフィスリート投資法人	726	63,525,000	
大和証券オフィス投資法人	179	126,911,000	
阪急阪神リート投資法人	400	63,440,000	
スターツプロシード投資法人	137	35,866,600	
大和ハウスリート投資法人	1,331	419,930,500	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	2,852	204,488,400	
大和証券リビング投資法人	1,161	138,623,400	
ジャパンエクセレント投資法人	812	109,538,800	
投資証券 小計		9,875,778,500	
合 計		9,875,778,500	

## 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15日現在)	(2022年9月15日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	49,504,198	172,770,312

金銭信託	17,968,476	2,086,455
コール・ローン	5,491,637	53,757,255
投資証券	15,280,172,870	24,904,441,990
派生商品評価勘定	15,223	1,242
未収入金	217,869	1,167,154
未収配当金	28,687,210	76,422,596
流動資産合計	15,382,057,483	25,210,647,004
資産合計	15,382,057,483	25,210,647,004
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	79,141	207,784
未払金	198,292,838	-
未払解約金	470,292	16,968,613
未払利息	14	-
その他未払費用	36	126
流動負債合計	198,842,321	17,176,523
負債合計	198,842,321	17,176,523
純資産の部		
元本等		
元本	5,796,191,821	8,386,046,114
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	9,387,023,341	16,807,424,367
元本等合計	15,183,215,162	25,193,470,481
純資産合計	15,183,215,162	25,193,470,481
負債純資産合計	15,382,057,483	25,210,647,004

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2021年9月16日 至 2022年9月15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15日現在）	（2022年9月15日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	5,796,191,821口	8,386,046,114口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.6195円 （1万口当たりの純資産額26,195円）	1口当たり純資産額 3.0042円 （1万口当たりの純資産額30,042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16日 至 2022年9月15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。

<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15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15日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

		契 約 額 等	
--	--	---------	--

区分	種類		うち 1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	167,500,000	-	167,452,205	47,795
	イギリス・ポンド	11,300,000	-	11,294,712	5,288
	オーストラリア・ドル	15,500,000	-	15,489,365	10,635
	カナダ・ドル	4,100,000	-	4,100,655	655
	シンガポール・ドル	4,900,000	-	4,899,741	259
	ユーロ	9,200,000	-	9,198,562	1,438
	香港・ドル	3,600,000	-	3,600,842	842
	小計	216,100,000	-	216,036,082	63,918
合計	216,100,000	-	216,036,082	63,918	

(2022年9月15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	251,800,000	-	251,596,496	203,504
	カナダ・ドル	7,100,000	-	7,100,704	704
	オーストラリア・ドル	21,100,000	-	21,097,074	2,926
	香港・ドル	5,800,000	-	5,798,983	1,017
	シンガポール・ドル	8,200,000	-	8,200,538	538
	イギリス・ポンド	16,100,000	-	16,099,960	40
	ユーロ	11,800,000	-	11,799,703	297
	小計	321,900,000	-	321,693,458	206,542
合計	321,900,000	-	321,693,458	206,542	

(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16日 至 2022年9月15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15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	4,117,357,156円
同期中における追加設定元本額	2,548,310,516円
同期中における一部解約元本額	869,475,851円
2021年9月15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	5,053,549,693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	58,149,715円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	597,514円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド	83,181,946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	802,404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>	47,609,004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>	13,755,435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>	34,135,132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>	168,560,701円
合計	5,796,191,821円

(2022年9月15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	5,796,191,821円
同期中における追加設定元本額	3,433,282,471円
同期中における一部解約元本額	843,428,178円

2022年9月15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	7,136,405,301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	79,892,384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	207,764,640円
日興FWS・Gリートインデックス（為替ヘッジあり）	69,417,859円
日興FWS・Gリートインデックス（為替ヘッジなし）	322,929,986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2021 05（リスク3%）<適格機関投資家限定>	74,020,828円
合計	8,386,046,114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	223,751.31	
		AGREE REALTY CORP	9,577.00	703,622.19	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	8,514.00	153,677.70	
		ALEXANDER'S INC	300.00	69,306.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	19,728.00	2,998,458.72	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	2,165.00	38,363.80	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	7,000.00	189,000.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	38,504.00	1,391,534.56	
		AMERICOLD REALTY TRUST INC	36,548.00	1,059,526.52	
		APARTMENT INCOME REIT CO	21,469.00	892,681.02	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	15,893.00	142,401.28	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	26,200.00	419,986.00	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	8,429.00	106,373.98	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	2,515.00	23,490.10	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	18,354.00	3,764,038.32	

BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,745.00	100,815.40	
BOSTON PROPERTIES INC	18,428.00	1,542,792.16	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	8,400.00	43,680.00	
BRANDYWINE REALTY TRUST	20,191.00	166,373.84	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	39,200.00	832,608.00	
BROADSTONE NET LEASE INC	23,684.00	450,943.36	
BRT APARTMENTS CORP	500.00	11,365.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	13,982.00	1,828,286.32	
CARETRUST REIT INC	13,303.00	269,651.81	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	3,648.00	109,038.72	
CENTERSPACE	1,542.00	115,495.80	
CHATHAM LODGING TRUST	5,557.00	71,018.46	
CITY OFFICE REIT INC	4,603.00	51,921.84	
CLIPPER REALTY INC	800.00	6,688.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3,216.00	112,817.28	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	14,223.00	362,259.81	
COUSINS PROPERTIES INC	19,300.00	524,960.00	
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY T	2,658.00	18,366.78	
CTO REALTY GROWTH INC	4,049.00	79,441.38	
CUBESMART	29,248.00	1,312,942.72	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	26,676.00	243,285.12	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	69,000.00	52,440.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	37,661.00	4,371,688.88	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	23,884.00	31,049.20	
DOUGLAS EMMETT INC	23,532.00	494,642.64	
DUKE REALTY CORP	50,677.00	2,910,886.88	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	20,000.00	2,740.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	11,869.00	211,268.20	
EASTGROUP PROPERTIES INC	5,350.00	872,638.50	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	21,276.00	154,251.00	
EPR PROPERTIES	9,600.00	406,656.00	
EQUINIX INC	11,951.00	7,489,452.68	
EQUITY COMMONWEALTH	14,758.00	392,415.22	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	22,846.00	1,637,601.28	
EQUITY RESIDENTIAL	44,916.00	3,333,216.36	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	17,620.00	388,344.80	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	8,570.00	2,267,536.30	
EXTRA SPACE STORAGE INC	17,528.00	3,359,241.20	
FARMLAND PARTNERS INC	4,666.00	67,796.98	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	9,300.00	933,162.00	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	17,000.00	875,160.00	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	9,736.00	255,570.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	15,115.00	46,100.75	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	31,074.00	1,511,128.62	



GETTY REALTY CORP	5,036.00	147,856.96	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5,368.00	98,717.52	
GLADSTONE LAND CORP	4,464.00	99,234.72	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	5,669.00	60,204.78	
GLOBAL NET LEASE INC	13,146.00	172,606.98	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	48,800.00	1,147,288.00	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	71,699.00	1,894,287.58	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	2,876.00	29,105.12	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	13,846.00	420,226.10	
HOST HOTELS & RESORTS INC	95,339.00	1,746,610.48	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	17,289.00	237,377.97	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	28,050.00	539,121.00	
INDUS REALTY TRUST INC	823.00	49,791.50	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	6,274.00	42,851.42	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,822.00	340,349.10	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	8,406.00	212,671.80	
INVITATION HOMES INC	81,066.00	3,097,531.86	
IRON MOUNTAIN INC	37,588.00	2,040,276.64	
JBG SMITH PROPERTIES	15,318.00	331,787.88	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	130,900.00	85,085.00	
KILROY REALTY CORP	14,505.00	724,089.60	
KIMCO REALTY CORP	80,018.00	1,665,974.76	
KITE REALTY GROUP TRUST	28,356.00	536,779.08	
LIFE STORAGE INC	10,858.00	1,328,476.30	
LTC PROPERTIES INC	5,036.00	217,051.60	
LXP INDUSTRIAL TRUST	37,000.00	361,120.00	
MACERICH CO/THE	30,200.00	280,256.00	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	245,900.00	124,179.50	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	77,231.00	1,065,015.49	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	15,117.00	2,535,120.90	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	22,700.00	1,001,297.00	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	11,732.00	564,191.88	
NATL HEALTH INVESTORS INC	6,051.00	377,884.95	
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	17,023.00	120,863.30	
NETSTREIT CORP	4,793.00	94,757.61	
NEXPOINT RESIDENTIAL	3,529.00	186,119.46	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	5,071.00	88,691.79	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	30,977.00	938,912.87	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,352.00	56,800.80	
ORION OFFICE REIT INC	5,199.00	52,145.97	
PARAMOUNT GROUP INC	20,155.00	141,488.10	
PARK HOTELS & RESORTS INC	32,432.00	465,723.52	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	17,544.00	313,160.40	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	360.00	1,602.00	

PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	15,254.00	487,365.30	
PHYSICIANS REALTY TRUST	31,204.00	501,760.32	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	14,040.00	169,884.00	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,774.00	96,387.06	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	1,424.00	21,530.88	
PRIME US REIT	130,700.00	80,380.50	
PROLOGIS INC	97,452.00	11,799,488.16	
PUBLIC STORAGE	20,149.00	6,541,977.32	
REALTY INCOME CORP	79,480.00	5,198,786.80	
REGENCY CENTERS CORP	20,620.00	1,214,518.00	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	16,432.00	261,268.80	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	21,881.00	1,352,683.42	
RLJ LODGING TRUST	20,173.00	249,338.28	
RPT REALTY	8,262.00	75,101.58	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	7,126.00	615,330.10	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	32,679.00	452,277.36	
SAFEHOLD INC	1,242.00	45,916.74	
SAUL CENTERS INC	2,331.00	96,410.16	
SERVICE PROPERTIES TRUST	25,446.00	171,760.50	
SIMON PROPERTY GROUP INC	43,445.00	4,345,803.35	
SITE CENTERS CORP	26,013.00	331,405.62	
SL GREEN REALTY CORP	8,071.00	372,880.20	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	17,135.00	704,077.15	
STAG INDUSTRIAL INC	22,400.00	688,800.00	
STORE CAPITAL CORP	32,202.00	862,691.58	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	14,098.00	114,334.78	
SUN COMMUNITIES INC	16,193.00	2,525,946.07	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	29,379.00	333,745.44	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	15,336.00	230,960.16	
TERRENO REALTY CORP	9,726.00	585,894.24	
UDR INC	38,676.00	1,766,332.92	
UMH PROPERTIES INC	6,284.00	113,991.76	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,344.00	65,251.20	
URBAN EDGE PROPERTIES	15,028.00	232,783.72	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	2,927.00	47,036.89	
VENTAS INC	52,399.00	2,537,159.58	
VERIS RESIDENTIAL INC	10,798.00	147,176.74	
VICI PROPERTIES INC	127,470.00	4,234,553.40	
VORNADO REALTY TRUST	21,846.00	578,700.54	
WASHINGTON REIT	10,790.00	215,368.40	
WELLTOWER INC	60,047.00	4,442,277.06	
WHITESTONE REIT	4,511.00	45,019.78	
WP CAREY INC	25,176.00	2,133,666.00	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	15,327.00	254,734.74	

	アメリカ・ドル小計	3,481,939.00	135,873,392.68 (19,476,092,107)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	8,800.00	273,592.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	9,662.00	102,417.20	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	2,725.00	38,150.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,190.00	155,065.90	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	13,622.00	48,494.32	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	11,424.00	501,742.08	
	CHOICE PROPERTIES REIT	17,893.00	247,102.33	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	5,107.00	80,486.32	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	4,551.00	74,636.40	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	17,899.00	213,356.08	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2,169.00	37,849.05	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	11,377.00	36,975.25	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	14,775.00	225,318.75	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4,448.00	329,063.04	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	16,425.00	202,027.50	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	1,387.00	6,324.72	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11,198.00	137,399.46	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	8,107.00	134,981.55	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,447.00	21,430.07	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1,557.00	25,565.94	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	4,345.00	41,451.30	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	12,305.00	151,105.40	
	PLAZA RETAIL REIT	8,509.00	35,227.26	
	PRIMARIS REIT	6,318.00	85,608.90	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	19,525.00	389,328.50		
SLATE GROCERY REIT-CL U	3,196.00	45,223.40		
SLATE OFFICE REIT	3,663.00	16,410.24		
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	9,440.00	262,904.00		
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	13,800.00	256,128.00		
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4,770.00	28,858.50		
	カナダ・ドル小計	253,634.00	4,204,223.46 (457,629,724)	
オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	50,980.00	133,057.80	
	ARENA REIT	45,981.00	184,843.62	
	BWP TRUST	66,965.00	265,181.40	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	104,758.00	196,421.25	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	84,443.00	254,173.43	
	CENTURIA OFFICE REIT	43,559.00	70,783.37	
	CHARTER HALL GROUP	64,246.00	812,711.90	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	73,852.00	324,210.28	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	62,449.00	250,420.49	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	37,955.00	130,944.75	

	CROMWELL PROPERTY GROUP	158,718.00	122,212.86	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	30,237.00	81,035.16	
	DEXUS/AU	137,000.00	1,130,250.00	
	GDI PROPERTY GROUP	43,204.00	39,531.66	
	GOODMAN GROUP	221,089.00	4,132,153.41	
	GPT GROUP	251,434.00	1,030,879.40	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	30,439.00	105,623.33	
	HEALTHCO REIT	51,410.00	85,083.55	
	HOME CONSORTIUM LTD	33,678.00	166,032.54	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	187,797.00	235,685.23	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	25,921.00	83,206.41	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	39,965.00	166,654.05	
	MIRVAC GROUP	534,373.00	1,106,152.11	
	NATIONAL STORAGE REIT	129,680.00	316,419.20	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	89,106.00	72,175.86	
	RURAL FUNDS GROUP	52,739.00	138,176.18	
	SCENTRE GROUP	698,931.00	1,957,006.80	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	143,852.00	374,015.20	
	STOCKLAND	314,996.00	1,086,736.20	
	VICINITY CENTRES	479,141.00	910,367.90	
	WAYPOINT REIT	113,111.00	283,908.61	
	オーストラリア・ドル小計	4,402,009.00	16,246,053.95 (1,570,181,114)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	239,000.00	814,990.00	
	FORTUNE REIT	208,000.00	1,316,640.00	
	LINK REIT	279,400.00	17,155,160.00	
	PROSPERITY REIT	178,000.00	388,040.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	110,000.00	399,300.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	230,000.00	531,300.00	
	香港・ドル小計	1,244,400.00	20,605,430.00 (376,255,152)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT	38,300.00	51,705.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	436,000.00	1,246,960.00	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	260,055.00	280,859.40	
	CAPITALAND CHINA TRUST	113,900.00	123,012.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERC	660,808.00	1,381,088.72	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	94,950.00	121,536.00	
	EC WORLD REIT	52,800.00	28,776.00	
	ESR-LOGOS REIT	606,713.00	239,651.63	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	190,000.00	116,850.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	176,400.00	48,510.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	141,800.00	320,468.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC	370,238.00	507,226.06	
	IREIT GLOBAL	57,600.00	31,104.00	

	KEPPEL DC REIT	170,900.00	333,255.00	
	KEPPEL REIT	275,800.00	300,622.00	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	262,000.00	210,910.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	273,200.00	699,392.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	432,950.00	744,674.00	
	MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	304,700.00	581,977.00	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	243,200.00	91,200.00	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	48,000.00	227,040.00	
	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	8,348,982.81 (851,262,287)	
ニュー ジーラン ド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	107,000.00	139,100.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	135,705.00	293,122.80	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	200,506.00	195,493.35	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	192,441.00	256,908.73	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	57,519.00	159,040.03	
	ニュージーランド・ドル小計	693,171.00	1,043,664.91 (89,890,859)	
イギリ ス・ボン ド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	53,280.00	36,390.24	
	AEW UK REIT PLC	9,000.00	9,396.00	
	ASSURA PLC	378,833.00	239,043.62	
	BALANCED COMM PROPERTY TRUST	89,651.00	84,720.19	
	BIG YELLOW GROUP PLC	23,140.00	279,299.80	
	BRITISH LAND CO PLC	118,763.00	482,415.30	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	125,000.00	144,500.00	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	108,964.00	81,940.92	
	CUSTODIAN REIT PLC	39,999.00	40,238.99	
	DERWENT LONDON PLC	15,701.00	378,080.08	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	95,000.00	92,910.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	30,485.00	151,266.57	
	HAMMERSON PLC	440,241.00	92,450.61	
	HOME REIT PLC	96,051.00	107,577.12	
	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	613,206.00	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	141,905.00	291,189.06	
	LXI REIT PLC	247,814.00	365,277.83	
	NEWRIVER REIT PLC	46,021.00	36,678.73	
PICTON PROPERTY INCOME LTD	57,141.00	48,912.69		
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	182,000.00	237,510.00		
PRS REIT PLC/THE	89,207.00	89,028.58		

	REGIONAL REIT LTD	45,664.00	31,736.48	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	25,924.00	253,666.34	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	70,698.00	34,429.92	
	SEGRO PLC	157,959.00	1,405,203.26	
	SHAFTESBURY PLC	36,339.00	144,265.83	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	187,422.00	224,906.40	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	34,770.00	30,145.59	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	236,658.00	384,805.90	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	117,847.00	76,600.55	
	UNITE GROUP PLC/THE	52,000.00	528,840.00	
	WORKSPACE GROUP PLC	20,210.00	101,454.20	
	イギリス・ポンド小計	3,543,003.00	7,167,547.41 (1,184,723,910)	
イスラエル・シュケル	REIT 1 LTD	26,169.00	539,343.09	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	25,500.00	249,900.00	
	イスラエル・シュケル小計	51,669.00	789,243.09 (33,008,277)	
韓国・ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	6,350.00	28,448,000.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	24,000.00	133,440,000.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	4,067.00	19,562,270.00	
	JR REIT XXVII	19,000.00	93,955,000.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	6,226.00	32,561,980.00	
	LOTTE REIT CO LTD	12,522.00	62,860,440.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	9,815.00	43,431,375.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	8,762.00	70,183,620.00	
	SK REITS CO LTD	12,831.00	70,057,260.00	
	韓国・ウォン小計	103,573.00	554,499,945.00 (57,058,044)	
ユーロ	AEDIFICA	5,146.00	452,076.10	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	1,760.00	13,666.40	
	ALTAREA	723.00	95,002.20	
	BEFIMMO	519.00	24,652.50	
	CARE PROPERTY INVEST	3,490.00	70,149.00	
	CARMILA	7,172.00	100,694.88	
	COFINIMMO	4,000.00	380,800.00	
	COVIVIO	6,175.00	330,053.75	
	CROMWELL REIT EUR	48,320.00	96,640.00	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	5,801.00	118,456.42	
	GECINA SA	7,026.00	620,044.50	
	HAMBORNER REIT AG	11,000.00	86,130.00	
	ICADE	3,844.00	167,675.28	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	4,798.00	15,857.39	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	34,858.00	194,507.64	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	3,500.00	82,075.00	

	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	52,815.00	63,694.89	
	KLEPIERRE	25,069.00	508,650.01	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	6,940.00	32,062.80	
	MERCIALYS	6,257.00	48,679.46	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	42,596.00	380,595.26	
	MONTEA NV	1,234.00	100,077.40	
	NSI NV	2,336.00	65,641.60	
	RETAIL ESTATES	1,586.00	94,684.20	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	15,400.00	784,784.00	
	VASTNED RETAIL NV	2,035.00	41,412.25	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	18,467.00	525,570.82	
	WERELDHAVE NV	5,522.00	69,632.42	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	2,441.00	89,950.85	
	ユーロ小計	330,830.00	5,653,917.02 (808,340,515)	
	投資証券合計		24,904,441,990 (24,904,441,990)	
	合 計		24,904,441,990 (24,904,441,990)	

(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	77.3%	78.2%
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	3.4%	3.4%
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%	4.8%
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%	3.2%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

### (1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2021年9月15日現在)	(2022年9月15日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	486,061,247	17,894,818
コール・ローン	148,553,054	461,057,773
国債証券	111,262,905,020	103,538,045,580

地方債証券	9,309,564,450	10,286,652,700
特殊債券	11,463,696,995	9,472,723,874
社債券	4,849,856,000	6,430,311,900
未収入金	337,017,000	299,298,000
未収利息	430,082,162	368,642,924
前払費用	10,168,350	16,642,812
流動資産合計	138,297,904,278	130,891,270,381
資産合計	138,297,904,278	130,891,270,381
負債の部		
流動負債		
未払金	540,656,000	302,060,000
未払解約金	410,000	9,849,999
未払利息	383	-
その他未払費用	1,476	711
流動負債合計	541,067,859	311,910,710
負債合計	541,067,859	311,910,710
純資産の部		
元本等		
元本	107,296,279,211	105,094,252,769
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	30,460,557,208	25,485,106,902
元本等合計	137,756,836,419	130,579,359,671
純資産合計	137,756,836,419	130,579,359,671
負債純資産合計	138,297,904,278	130,891,270,381

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2021年9月16日 至 2022年9月15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15日現在)	(2022年9月15日現在)
1. 当計算期間の末日における 受益権の総数	107,296,279,211口	105,094,252,769口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2839円 (1万口当たりの純資産額12,839円)	1口当たり純資産額 1.2425円 (1万口当たりの純資産額12,425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16日 至 2022年9月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項 目	(2022年9月15日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

#### (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

#### (関連当事者との取引に関する注記)

自 2021年9月16日

至 2022年9月15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15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	103,559,131,437円
同期中における追加設定元本額	22,521,825,732円
同期中における一部解約元本額	18,784,677,958円
2021年9月15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)	6,460,445,852円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	11,448,337,963円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,614,840,289円
SMAM・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)	674,885,416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)	319,844,376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)	461,952,707円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	141,487,997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DS・DCターゲットイヤーファンド2050	41,016,697円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,618,467,794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)	178,903,993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NISA・世界分散ファンド	120,859,694円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	102,416,811円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	177,326,252円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	51,220,521円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	5,771,707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>	13,706,248,701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>	2,459,305,568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

S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 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・V A S ( 適格機関投資家専用 )	1,249,600,072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 >	465,435,023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 >	570,338,804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 >	178,863,776円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	43,132,304円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	1,545,296,247円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	2,226,859,326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 >	753,200,032円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	209,761,569円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	19,071,373円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 0 L 2 < 適格機関投資家専用 >	284,228,228円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	5,448,462,272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 >	416,502,680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 >	820,434,999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 >	889,288,444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 >	5,225,285,939円
合 計	107,296,279,211円

( 2022年9月15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	107,296,279,211円
同期中における追加設定元本額	23,725,965,224円
同期中における一部解約元本額	25,927,991,666円

## 2022年9月15日現在の元本の内訳

三井住友・D C 年金バランス 3 0 ( 債券重点型 )	7,406,697,874円
三井住友・D C 年金バランス 5 0 ( 標準型 )	12,270,168,802円
三井住友・D C 年金バランス 7 0 ( 株式重点型 )	2,847,369,109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 )	824,032,455円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 2 0 ( 4 資産タイプ )	41,070,800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 )	188,185,362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 )	504,237,561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 )	881,912,608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 )	451,171,893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 )	581,608,933円
三井住友・D C 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 ・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 5 0	58,773,995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 )	655,230,772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・D C つみたて N I S A ・ 世界分散ファンド	198,023,292円

三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	284,295,813円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	506,406,377円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	146,630,256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>	1,216,302,744円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	11,444,903,991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)	1,110,028,448円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	411,827,535円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	501,218,442円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	171,990,647円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	43,709,085円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,353,212,908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>	649,175,832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>	4,983,463,845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>	1,216,079,460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	105,094,252,769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	438 2年国債	5,770,000,000	5,779,289,700	
	439 2年国債	1,000,000,000	1,001,680,000	
	141 5年国債	795,000,000	797,957,400	
	142 5年国債	760,000,000	763,093,200	

143	5年国債	770,000,000	773,380,300	
144	5年国債	980,000,000	984,596,200	
145	5年国債	1,180,000,000	1,185,864,600	
146	5年国債	1,000,000,000	1,005,220,000	
147	5年国債	1,540,000,000	1,543,234,000	
148	5年国債	1,530,000,000	1,532,876,400	
149	5年国債	1,240,000,000	1,241,488,000	
150	5年国債	1,270,000,000	1,270,533,400	
151	5年国債	230,000,000	229,843,600	
152	5年国債	340,000,000	341,224,000	
153	5年国債	1,550,000,000	1,547,055,000	
1	40年国債	40,000,000	50,966,400	
2	40年国債	242,000,000	297,241,340	
3	40年国債	185,000,000	228,214,150	
4	40年国債	247,000,000	304,968,430	
5	40年国債	235,000,000	278,698,250	
6	40年国債	240,000,000	278,448,000	
7	40年国債	265,000,000	294,619,050	
8	40年国債	310,000,000	320,375,700	
9	40年国債	493,000,000	374,995,520	
10	40年国債	460,000,000	410,784,600	
11	40年国債	360,000,000	310,240,800	
12	40年国債	370,000,000	285,410,600	
13	40年国債	475,000,000	364,481,750	
14	40年国債	515,000,000	422,686,250	
15	40年国債	230,000,000	206,859,700	
335	10年国債	90,000,000	91,060,200	
336	10年国債	340,000,000	344,464,200	
337	10年国債	120,000,000	121,032,000	
338	10年国債	805,000,000	814,595,600	
339	10年国債	785,000,000	795,197,150	
340	10年国債	770,000,000	780,795,400	
341	10年国債	557,000,000	563,544,750	
342	10年国債	350,000,000	351,904,000	
343	10年国債	310,000,000	311,689,500	
344	10年国債	811,000,000	815,063,110	
345	10年国債	258,000,000	259,153,260	
346	10年国債	340,000,000	341,224,000	
347	10年国債	100,000,000	100,284,000	
348	10年国債	545,000,000	546,220,800	
349	10年国債	980,000,000	981,538,600	
350	10年国債	390,000,000	390,319,800	
351	10年国債	390,000,000	390,000,000	
352	10年国債	430,000,000	429,613,000	
353	10年国債	450,000,000	449,298,000	

354	10年国債	725,000,000	723,129,500	
355	10年国債	550,000,000	547,789,000	
356	10年国債	310,000,000	308,388,000	
357	10年国債	1,410,000,000	1,399,904,400	
358	10年国債	880,000,000	871,877,600	
359	10年国債	1,020,000,000	1,009,116,600	
360	10年国債	1,030,000,000	1,017,856,300	
361	10年国債	1,000,000,000	987,460,000	
362	10年国債	1,180,000,000	1,164,282,400	
363	10年国債	1,300,000,000	1,281,631,000	
365	10年国債	1,050,000,000	1,037,620,500	
366	10年国債	240,000,000	240,110,400	
367	10年国債	2,470,000,000	2,458,218,100	
2	30年国債	510,000,000	592,140,600	
4	30年国債	340,000,000	412,868,800	
5	30年国債	290,000,000	338,151,600	
7	30年国債	474,000,000	565,780,620	
9	30年国債	240,000,000	266,145,600	
10	30年国債	465,000,000	501,358,350	
11	30年国債	430,000,000	490,440,800	
12	30年国債	570,000,000	675,039,600	
14	30年国債	622,000,000	760,096,440	
16	30年国債	465,000,000	575,916,450	
18	30年国債	190,000,000	231,617,600	
19	30年国債	470,000,000	573,526,900	
21	30年国債	345,000,000	422,224,800	
22	30年国債	315,000,000	394,458,750	
23	30年国債	329,000,000	412,641,670	
24	30年国債	310,000,000	389,394,100	
25	30年国債	290,000,000	357,106,000	
26	30年国債	363,000,000	452,308,890	
27	30年国債	250,000,000	315,627,500	
28	30年国債	386,000,000	488,313,160	
29	30年国債	177,000,000	221,435,850	
30	30年国債	212,000,000	262,191,000	
31	30年国債	325,000,000	396,990,750	
32	30年国債	360,000,000	446,004,000	
33	30年国債	368,000,000	437,861,120	
34	30年国債	87,000,000	106,461,900	
35	30年国債	340,000,000	405,317,400	
36	30年国債	90,000,000	107,407,800	
37	30年国債	405,000,000	476,097,750	
38	30年国債	380,000,000	439,584,000	
39	30年国債	220,000,000	258,480,200	
40	30年国債	270,000,000	312,109,200	

4 1	3 0 年国債	270,000,000	306,900,900	
4 2	3 0 年国債	280,000,000	318,068,800	
4 3	3 0 年国債	225,000,000	255,426,750	
4 4	3 0 年国債	290,000,000	328,993,400	
4 5	3 0 年国債	355,000,000	388,377,100	
4 6	3 0 年国債	315,000,000	344,250,900	
4 7	3 0 年国債	280,000,000	311,432,800	
4 8	3 0 年国債	455,000,000	487,218,550	
4 9	3 0 年国債	315,000,000	336,867,300	
5 0	3 0 年国債	325,000,000	306,501,000	
5 1	3 0 年国債	315,000,000	263,314,800	
5 2	3 0 年国債	303,000,000	264,943,200	
5 3	3 0 年国債	277,000,000	247,397,010	
5 4	3 0 年国債	75,000,000	69,981,000	
5 5	3 0 年国債	295,000,000	274,571,250	
5 6	3 0 年国債	390,000,000	362,076,000	
5 7	3 0 年国債	355,000,000	328,428,250	
5 8	3 0 年国債	480,000,000	442,502,400	
5 9	3 0 年国債	350,000,000	314,020,000	
6 0	3 0 年国債	330,000,000	309,757,800	
6 1	3 0 年国債	255,000,000	227,271,300	
6 2	3 0 年国債	195,000,000	164,408,400	
6 3	3 0 年国債	220,000,000	179,797,200	
6 4	3 0 年国債	305,000,000	248,385,900	
6 5	3 0 年国債	295,000,000	240,351,250	
6 6	3 0 年国債	310,000,000	252,699,600	
6 7	3 0 年国債	320,000,000	273,468,800	
6 8	3 0 年国債	350,000,000	298,770,500	
6 9	3 0 年国債	370,000,000	324,453,000	
7 0	3 0 年国債	350,000,000	306,001,500	
7 1	3 0 年国債	390,000,000	340,302,300	
7 2	3 0 年国債	260,000,000	226,421,000	
7 3	3 0 年国債	290,000,000	252,314,500	
7 4	3 0 年国債	350,000,000	329,010,500	
7 5	3 0 年国債	430,000,000	434,661,200	
7 2	2 0 年国債	753,000,000	786,139,530	
7 4	2 0 年国債	664,000,000	696,775,040	
7 5	2 0 年国債	490,000,000	516,763,800	
7 8	2 0 年国債	590,000,000	622,125,500	
8 2	2 0 年国債	620,000,000	660,492,200	
8 4	2 0 年国債	500,000,000	533,645,000	
8 5	2 0 年国債	645,000,000	693,710,400	
8 8	2 0 年国債	742,000,000	807,511,180	
8 9	2 0 年国債	20,000,000	21,690,600	
9 0	2 0 年国債	580,000,000	631,811,400	



9 2	20年国債	424,000,000	462,028,560	
9 3	20年国債	632,000,000	688,342,800	
9 5	20年国債	305,000,000	337,659,400	
9 7	20年国債	327,000,000	362,047,860	
9 9	20年国債	153,000,000	169,277,670	
1 0 0	20年国債	207,000,000	231,059,610	
1 0 1	20年国債	355,000,000	400,152,450	
1 0 2	20年国債	457,000,000	517,333,140	
1 0 5	20年国債	390,000,000	436,343,700	
1 0 6	20年国債	370,000,000	416,176,000	
1 0 7	20年国債	378,000,000	424,501,560	
1 0 8	20年国債	390,000,000	433,134,000	
1 0 9	20年国債	140,000,000	155,937,600	
1 1 1	20年国債	386,000,000	438,943,760	
1 1 3	20年国債	227,000,000	257,442,970	
1 1 4	20年国債	263,000,000	298,973,140	
1 1 6	20年国債	100,000,000	114,706,000	
1 1 8	20年国債	200,000,000	227,070,000	
1 1 9	20年国債	295,000,000	330,429,500	
1 2 0	20年国債	200,000,000	220,970,000	
1 2 1	20年国債	55,000,000	62,200,050	
1 2 2	20年国債	330,000,000	370,606,500	
1 2 3	20年国債	80,000,000	92,052,000	
1 2 4	20年国債	190,000,000	217,084,500	
1 2 5	20年国債	205,000,000	238,396,550	
1 2 6	20年国債	180,000,000	206,323,200	
1 2 7	20年国債	145,000,000	164,996,950	
1 2 8	20年国債	65,000,000	74,192,300	
1 3 0	20年国債	155,000,000	176,326,450	
1 3 1	20年国債	380,000,000	428,932,600	
1 3 2	20年国債	450,000,000	509,746,500	
1 3 3	20年国債	190,000,000	216,947,700	
1 3 4	20年国債	200,000,000	228,786,000	
1 3 5	20年国債	155,000,000	175,869,200	
1 3 6	20年国債	120,000,000	135,043,200	
1 3 7	20年国債	185,000,000	210,354,250	
1 3 9	20年国債	60,000,000	67,651,800	
1 4 0	20年国債	340,000,000	387,011,800	
1 4 2	20年国債	190,000,000	218,367,000	
1 4 3	20年国債	150,000,000	169,429,500	
1 4 4	20年国債	170,000,000	190,292,900	
1 4 5	20年国債	110,000,000	125,461,600	
1 4 6	20年国債	215,000,000	245,381,650	
1 4 7	20年国債	260,000,000	294,091,200	
1 4 8	20年国債	219,000,000	245,499,000	

149	20年国債	495,000,000	555,211,800	
150	20年国債	391,000,000	434,068,650	
151	20年国債	530,000,000	575,850,300	
152	20年国債	595,000,000	645,920,100	
153	20年国債	437,000,000	479,502,620	
154	20年国債	380,000,000	411,988,400	
155	20年国債	410,000,000	433,874,300	
156	20年国債	460,000,000	450,473,400	
157	20年国債	555,000,000	527,449,800	
158	20年国債	380,000,000	375,329,800	
159	20年国債	388,000,000	387,743,920	
160	20年国債	445,000,000	449,734,800	
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	393,392,700	
165	20年国債	410,000,000	396,949,700	
166	20年国債	515,000,000	512,414,700	
167	20年国債	380,000,000	365,434,600	
168	20年国債	450,000,000	424,368,000	
169	20年国債	400,000,000	369,624,000	
170	20年国債	385,000,000	354,319,350	
171	20年国債	385,000,000	353,125,850	
172	20年国債	480,000,000	446,400,000	
173	20年国債	365,000,000	338,351,350	
174	20年国債	990,000,000	914,690,700	
175	20年国債	565,000,000	529,551,900	
176	20年国債	550,000,000	513,870,500	
177	20年国債	560,000,000	512,590,400	
178	20年国債	480,000,000	446,654,400	
179	20年国債	370,000,000	343,448,800	
180	20年国債	500,000,000	489,670,000	
181	20年国債	760,000,000	756,823,200	
	国債証券 小計		103,538,045,580	
地方債証券	727 東京都公債	500,000,000	504,540,000	
	792 東京都公債	300,000,000	295,896,900	
	1 東京都30年	100,000,000	118,101,900	
	8 東京都30年	400,000,000	485,353,200	
	13 東京都30年	500,000,000	585,263,000	
	1 東京都20年	100,000,000	101,227,600	
	6 東京都20年	100,000,000	104,853,600	
	26-15 北海道公債	100,000,000	100,901,300	
	30-18 北海道公債	200,000,000	198,241,600	
	210 神奈川県公債	100,000,000	100,890,400	
	211 神奈川県公債	100,000,000	100,870,200	

1	神奈川県20年	100,000,000	104,414,900	
3	神奈川県20年	100,000,000	105,646,100	
7	神奈川県20年	100,000,000	109,364,900	
13	神奈川県20年	100,000,000	113,487,800	
373	大阪府公債	100,000,000	100,758,300	
377	大阪府公債	100,000,000	100,827,900	
388	大阪府公債	100,000,000	100,988,100	
392	大阪府公債	100,000,000	100,705,500	
193	大阪府5年	300,000,000	297,939,900	
27-4	京都府公債	100,000,000	101,349,500	
29-12	京都府5年	300,000,000	300,118,200	
1-6	京都府5年	200,000,000	199,822,600	
5	兵庫県公債15年	300,000,000	318,089,400	
10	兵庫県公債20年	100,000,000	113,697,600	
7	静岡県30年	100,000,000	117,639,700	
1	静岡県20年	100,000,000	106,371,400	
22-8	愛知県20年	200,000,000	223,881,200	
27-16	愛知県公債	400,000,000	405,050,400	
25-11	福岡県公債	100,000,000	100,969,200	
26-3	福岡県公債	100,000,000	101,007,300	
26-10	福岡県公債	100,000,000	100,961,900	
1-1	福岡県公債	200,000,000	196,536,800	
1-3	福岡県30年	100,000,000	80,516,000	
25-8	千葉県公債	100,000,000	100,798,400	
26-4	千葉県公債	100,000,000	101,028,300	
137	共同発行地方	200,000,000	202,014,200	
138	共同発行地方	200,000,000	202,056,600	
172	共同発行地方	500,000,000	501,673,000	
183	共同発行地方	600,000,000	599,214,000	
1-1	大阪市5年	300,000,000	299,853,900	
1	名古屋市20年	200,000,000	205,011,200	
3	名古屋市20年	100,000,000	105,425,600	
5	名古屋市20年	100,000,000	108,817,100	
29-5	京都市5年	100,000,000	100,040,600	
1	京都市30年	100,000,000	125,601,900	
7	京都市20年	100,000,000	112,706,600	
26-17	神戸市公債	100,000,000	100,524,500	
26-3	横浜市公債	200,000,000	202,032,800	
4	横浜市20年	100,000,000	104,923,400	
9	横浜市20年	100,000,000	108,495,700	
14	横浜市20年	100,000,000	111,579,600	
26-4	札幌市公債	100,000,000	100,880,200	
94	川崎市公債	100,000,000	97,662,700	
1-2	北九州市5年	100,000,000	99,909,900	
29-11	福岡市5年	300,000,000	300,118,200	

	地方債証券 小計		10,286,652,700	
特殊債券	4 7 日本政策投資 C O	100,000,000	104,470,000	
	3 政保政策投資 C O	200,000,000	205,426,200	
	3 6 日本政策投資 B	100,000,000	109,311,000	
	1 8 道路機構	100,000,000	133,254,800	
	2 2 道路機構	300,000,000	387,327,000	
	2 7 道路機構	100,000,000	110,503,600	
	3 7 道路機構	300,000,000	336,097,500	
	4 7 道路機構	200,000,000	226,878,200	
	1 0 4 道路機構	400,000,000	401,432,800	
	7 9 政保道路機構	200,000,000	224,818,600	
	8 1 政保道路機構	200,000,000	225,074,200	
	8 8 政保道路機構	100,000,000	122,894,900	
	9 0 政保道路機構	500,000,000	564,731,500	
	9 9 政保道路機構	100,000,000	114,058,100	
	1 7 6 政保道路機構	100,000,000	112,689,600	
	1 9 6 政保道路機構	100,000,000	114,113,600	
	2 1 0 政保道路機構	200,000,000	223,716,000	
	2 2 7 政保道路機構	200,000,000	202,333,800	
	2 3 1 政保道路機構	300,000,000	303,423,000	
	2 8 8 政保道路機構	189,000,000	188,832,168	
	9 道路債券	100,000,000	123,265,000	
	2 地方公営 2 0 年	100,000,000	112,707,800	
	6 1 地方公共団体	100,000,000	101,069,100	
	6 2 地方公共団体	400,000,000	404,010,400	
	6 3 地方公共団体	100,000,000	100,957,400	
	6 4 地方公共団体	100,000,000	100,979,200	
	6 7 政保地方公共団	100,000,000	101,087,100	
	1 0 1 地方公共団体	100,000,000	99,944,900	
	1 0 6 地方公共団体	200,000,000	199,309,200	
	3 公営企業 2 0 年	100,000,000	100,527,700	
	5 公営企業 2 0 年	100,000,000	102,115,000	
	1 7 公営企業 2 0 年	100,000,000	107,963,700	
	2 0 公営企業 2 0 年	100,000,000	109,214,900	
	2 2 公営企業 2 0 年	100,000,000	109,925,300	
	2 4 公営企業 2 0 年	200,000,000	222,283,600	
	1 1 7 都市再生	100,000,000	102,780,000	
	5 2 住宅支援機構	100,000,000	112,049,100	
	1 3 0 住宅支援機構	200,000,000	224,680,800	
	2 2 6 住宅支援機構	100,000,000	99,839,100	
	S 9 住宅金融 R M B S	19,576,000	19,597,533	
S 1 0 住宅金融 R M B S	30,096,000	30,393,950		
S 3 住宅機構 R M B S	10,541,000	10,644,301		
S 5 住宅機構 R M B S	22,522,000	22,891,360		
S 7 住宅機構 R M B S	11,518,000	11,703,439		

S 9	住宅機構 R M B S	11,783,000	12,085,823	
S 1 0	住宅機構 R M B S	11,553,000	11,758,643	
S 1 1	住宅機構 R M B S	12,427,000	12,781,169	
2 9	住宅金融 R M B S	9,713,000	9,720,770	
3 2	住宅金融 R M B S	10,482,000	10,558,518	
3 5	住宅金融 R M B S	11,306,000	11,481,243	
3 9	住宅金融 R M B S	10,267,000	10,351,189	
4 1	住宅金融 R M B S	10,975,000	11,161,575	
4 3	住宅金融 R M B S	21,014,000	21,240,951	
5 1	住宅金融 R M B S	10,021,000	10,121,210	
5 3	住宅金融 R M B S	10,766,000	10,952,251	
1	住宅機構 R M B S	19,674,000	19,693,674	
2	住宅機構 R M B S	22,184,000	22,605,496	
4	住宅機構 R M B S	10,233,000	10,343,516	
6	住宅機構 R M B S	10,282,000	10,383,791	
1 9	住宅機構 R M B S	15,064,000	15,735,854	
2 4	住宅機構 R M B S	30,576,000	32,117,030	
2 6	住宅機構 R M B S	47,922,000	50,246,217	
2 7	住宅機構 R M B S	17,047,000	17,911,282	
2 8	住宅機構 R M B S	19,097,000	20,170,251	
2 9	住宅機構 R M B S	21,061,000	22,324,660	
3 0	住宅機構 R M B S	20,978,000	22,253,462	
3 2	住宅機構 R M B S	41,000,000	43,173,000	
3 5	住宅機構 R M B S	20,747,000	21,877,711	
3 6	住宅機構 R M B S	20,175,000	21,205,942	
4 3	住宅機構 R M B S	25,659,000	27,013,795	
4 6	住宅機構 R M B S	20,147,000	21,200,688	
4 8	住宅機構 R M B S	38,000,000	39,907,600	
4 9	住宅機構 R M B S	19,277,000	20,167,597	
5 1	住宅機構 R M B S	42,368,000	44,299,980	
5 5	住宅機構 R M B S	56,420,000	58,891,196	
5 7	住宅機構 R M B S	27,087,000	28,273,410	
5 8	住宅機構 R M B S	30,130,000	31,479,824	
5 9	住宅機構 R M B S	57,586,000	60,200,404	
6 0	住宅機構 R M B S	88,662,000	92,332,606	
6 1	住宅機構 R M B S	29,947,000	31,084,986	
6 7	住宅機構 R M B S	37,617,000	38,813,220	
6 9	住宅機構 R M B S	77,304,000	80,434,812	
7 0	住宅機構 R M B S	67,788,000	70,363,944	
7 3	住宅機構 R M B S	38,642,000	40,245,643	
9 9	住宅機構 R M B S	58,607,000	59,708,811	
1 2 3	住宅機構 R M B S	76,580,000	75,553,828	
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	76,862,343	

	1 2 8 住宅機構 R M B S	77,402,000	76,062,945	
	1 2 9 住宅機構 R M B S	79,134,000	77,931,163	
	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	92,065,986	
	1 8 3 住宅機構 R M B S	199,726,000	196,530,384	
	8 5 中日本高速道	300,000,000	299,104,500	
	特殊債券 小計		9,472,723,874	
社債券	2 BPCE S.A.	200,000,000	200,016,200	
	8 6 東日本高速道	200,000,000	198,364,200	
	2 0 西日本高速道	100,000,000	100,708,100	
	2 3 西日本高速道	100,000,000	100,840,200	
	6 1 西日本高速道	200,000,000	198,807,600	
	1 3 大和ハウス	100,000,000	99,795,900	
	1 7 アサヒグループHD	200,000,000	199,638,200	
	3 0 東レ	100,000,000	100,057,900	
	5 6 住友化学	200,000,000	199,216,800	
	2 4 三菱ケミカルホールデイ	100,000,000	99,438,800	
	1 6 日立製作所	100,000,000	100,928,300	
	2 2 パナソニック	100,000,000	99,118,500	
	9 TDK	100,000,000	98,022,800	
	6 3 三井物産	100,000,000	109,372,500	
	8 みずほコーポレート	100,000,000	110,308,200	
	1 三井住友F G劣後	100,000,000	100,868,300	
	8 住友信託 劣後	100,000,000	108,356,600	
	1 みずほF G劣後	100,000,000	100,812,500	
	9 みずほ銀行劣後	100,000,000	108,391,400	
	1 7 NTTファイナンス	200,000,000	199,338,200	
	7 3 ホンダファイナンス	200,000,000	198,945,600	
	2 0 7 オリックス	200,000,000	198,523,800	
	2 三菱HCキャピタル	200,000,000	197,633,400	
	1 野村ホールディングス	100,000,000	100,015,400	
	5 8 三菱地所	100,000,000	121,823,900	
	1 3 5 三菱地所	200,000,000	194,339,600	
	1 0 東急	100,000,000	96,981,200	
	3 8 京王電鉄	100,000,000	99,810,100	
	1 1 0 東日本旅客鉄	100,000,000	110,857,300	
	1 6 9 東日本旅客鉄	200,000,000	193,757,000	
	6 0 西日本旅客鉄	200,000,000	196,550,600	
	4 1 東海旅客鉄道	100,000,000	111,345,100	
	4 2 東海旅客鉄道	100,000,000	112,558,000	
	4 5 東京地下鉄	100,000,000	97,752,800	
	6 4 阪急阪神H L D G	100,000,000	99,322,200	
	5 4 6 中部電力	200,000,000	191,329,200	
	5 5 3 中部電力	200,000,000	198,449,000	
	5 5 0 関西電力	300,000,000	298,824,300	

508 東北電力	200,000,000	197,305,600	
547 東北電力	100,000,000	98,756,100	
496 九州電力	300,000,000	288,077,700	
38 東京電力パワー	100,000,000	100,154,600	
41 大阪瓦斯	200,000,000	194,737,800	
7 ファーストリテイリング	100,000,000	100,060,400	
社債券 小計		6,430,311,900	
合計		129,727,734,054	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2021年9月15日現在)	(2022年9月15日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
預金	115,651,826	216,564,438
金銭信託	445,214,856	18,064,600
コール・ローン	136,069,327	465,432,190
国債証券	158,592,169,610	155,890,377,628
未収入金	-	190,000,000
未収利息	875,129,168	920,933,624
前払費用	26,157,612	58,682,007
流動資産合計	160,190,392,399	157,760,054,487
資産合計	160,190,392,399	157,760,054,487
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	106,728,032	127,693,366
未払利息	351	-
その他未払費用	1,413	2,226
流動負債合計	106,729,796	127,695,592
負債合計	106,729,796	127,695,592
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	81,268,533,582	76,838,969,286
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	78,815,129,021	80,793,389,609
元本等合計	160,083,662,603	157,632,358,895
純資産合計	160,083,662,603	157,632,358,895
負債純資産合計	160,190,392,399	157,760,054,487

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年9月16日 至 2022年9月15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15日現在)	(2022年9月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	81,268,533,582口	76,838,969,286口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.9698円 (1万口当たりの純資産額19,698円)	1口当たり純資産額 2.0515円 (1万口当たりの純資産額20,515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16日 至 2022年9月15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15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）</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16日 至 2022年9月15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15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	86,672,161,351円
同期中における追加設定元本額	8,945,685,891円
同期中における一部解約元本額	14,349,313,660円
2021年9月15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	24,375,165,327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）	2,128,168,842円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	1,134,090,695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）	140,095,839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）	239,826,544円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	24,471,452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）	28,182,434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	104,754,567円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	200,219,110円

三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	12,106,933円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	32,803,570円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	22,150,867円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,248,880円
日興FWS・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	3,210,021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>	733,010,223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>	1,449,959,893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	81,268,533,582円

(2022年9月15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

81,268,533,582円

同期中における追加設定元本額	11,553,388,274円
同期中における一部解約元本額	15,982,952,570円
2022年9月15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	25,304,482,065円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	827,910,098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)	152,307,236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)	248,203,179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)	23,049,883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
イオン・バランス戦略ファンド	91,907,319円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	21,357,598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	159,295,969円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	577,222,845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)	89,616,419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)	403,500,040円
三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド	15,941,186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>	3,750,777,043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>	6,103,985,887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>	4,100,250,322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>	1,378,765,001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>	4,285,807,535円
S M A M・バランスV A株4 0 T<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>	7,287,566,777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)	314,842,938円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	123,562,590円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	70,414,909円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	31,256,873円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,647,293円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	83,863,867円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	376,933,887円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	87,683,866円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	37,410,392円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,501,058円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	925,220,721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	76,838,969,286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	7,312,536.00	
		T 0.125 10/15/23	5,700,000.00	5,471,088.00	
		T 0.25 05/31/25	4,400,000.00	4,000,876.00	
		T 0.25 06/30/25	2,900,000.00	2,631,054.00	
		T 0.25 07/31/25	300,000.00	271,242.00	
		T 0.25 09/30/25	2,000,000.00	1,798,420.00	
		T 0.25 11/15/23	3,000,000.00	2,879,520.00	
		T 0.375 04/30/25	3,000,000.00	2,743,350.00	
		T 0.375 07/31/27	2,500,000.00	2,142,850.00	
		T 0.375 09/15/24	3,000,000.00	2,804,520.00	
		T 0.375 09/30/27	4,800,000.00	4,088,976.00	
		T 0.375 11/30/25	2,000,000.00	1,795,000.00	
		T 0.375 12/31/25	3,000,000.00	2,685,690.00	
		T 0.5 03/31/25	600,000.00	552,558.00	
		T 0.5 04/30/27	1,200,000.00	1,042,020.00	
T 0.5 05/31/27	2,500,000.00	2,165,025.00			

T 0.5 06/30/27	4,000,000.00	3,457,480.00	
T 0.625 03/31/27	2,400,000.00	2,101,488.00	
T 0.625 05/15/30	7,500,000.00	6,084,900.00	
T 0.625 07/31/26	3,600,000.00	3,201,156.00	
T 0.625 08/15/30	7,000,000.00	5,651,380.00	
T 0.625 10/15/24	4,400,000.00	4,123,944.00	
T 0.625 11/30/27	2,100,000.00	1,804,677.00	
T 0.625 12/31/27	7,200,000.00	6,172,560.00	
T 0.75 01/31/28	5,900,000.00	5,085,741.00	
T 0.75 11/15/24	5,200,000.00	4,873,336.00	
T 0.875 01/31/24	2,000,000.00	1,921,080.00	
T 0.875 11/15/30	7,000,000.00	5,754,210.00	
T 1 07/31/28	5,900,000.00	5,096,302.00	
T 1 12/15/24	4,500,000.00	4,230,675.00	
T 1.125 01/15/25	2,000,000.00	1,881,240.00	
T 1.125 02/15/31	8,500,000.00	7,106,085.00	
T 1.125 02/28/25	1,500,000.00	1,406,595.00	
T 1.125 02/28/27	2,000,000.00	1,794,840.00	
T 1.125 05/15/40	2,000,000.00	1,321,240.00	
T 1.125 08/15/40	3,200,000.00	2,091,744.00	
T 1.125 08/31/28	3,500,000.00	3,039,225.00	
T 1.25 05/15/50	5,100,000.00	3,022,515.00	
T 1.25 06/30/28	3,000,000.00	2,635,530.00	
T 1.25 08/15/31	5,200,000.00	4,342,000.00	
T 1.25 09/30/28	4,500,000.00	3,930,975.00	
T 1.25 11/30/26	4,200,000.00	3,803,604.00	
T 1.25 12/31/26	2,300,000.00	2,080,143.00	
T 1.375 01/31/25	1,900,000.00	1,796,374.00	
T 1.375 08/15/50	4,500,000.00	2,760,435.00	
T 1.375 08/31/23	2,500,000.00	2,440,125.00	
T 1.375 08/31/26	7,100,000.00	6,498,701.00	
T 1.375 09/30/23	3,000,000.00	2,921,580.00	
T 1.375 10/31/28	6,000,000.00	5,275,260.00	
T 1.375 11/15/31	4,900,000.00	4,117,911.00	
T 1.375 11/15/40	2,000,000.00	1,362,800.00	
T 1.375 12/31/28	2,500,000.00	2,195,800.00	
T 1.5 01/31/27	4,400,000.00	4,018,080.00	
T 1.5 02/15/25	3,000,000.00	2,840,130.00	
T 1.5 02/15/30	2,100,000.00	1,833,552.00	
T 1.5 09/30/24	3,000,000.00	2,867,340.00	
T 1.5 10/31/24	5,500,000.00	5,246,450.00	
T 1.5 11/30/24	800,000.00	761,680.00	
T 1.5 11/30/28	2,300,000.00	2,033,959.00	
T 1.625 02/15/26	2,900,000.00	2,701,756.00	

T 1.625 05/15/26	14,950,000.00	13,877,786.00	
T 1.625 05/15/31	5,500,000.00	4,769,050.00	
T 1.625 08/15/29	450,000.00	398,952.00	
T 1.625 09/30/26	3,900,000.00	3,603,210.00	
T 1.625 10/31/23	3,000,000.00	2,925,810.00	
T 1.625 11/15/50	3,200,000.00	2,104,000.00	
T 1.625 11/30/26	200,000.00	184,156.00	
T 1.75 01/31/29	4,300,000.00	3,858,218.00	
T 1.75 03/15/25	1,500,000.00	1,427,565.00	
T 1.75 06/30/24	6,200,000.00	5,982,504.00	
T 1.75 07/31/24	850,000.00	819,187.50	
T 1.75 08/15/41	2,900,000.00	2,090,929.00	
T 1.75 11/15/29	2,000,000.00	1,787,500.00	
T 1.75 12/31/24	4,000,000.00	3,823,720.00	
T 1.75 12/31/26	3,500,000.00	3,237,080.00	
T 1.875 02/15/32	5,300,000.00	4,647,623.00	
T 1.875 02/15/41	2,800,000.00	2,084,236.00	
T 1.875 02/15/51	5,800,000.00	4,067,656.00	
T 1.875 02/28/27	3,400,000.00	3,153,738.00	
T 1.875 02/28/29	2,800,000.00	2,531,256.00	
T 1.875 08/31/24	3,800,000.00	3,666,088.00	
T 1.875 11/15/51	1,300,000.00	910,598.00	
T 2 02/15/25	3,500,000.00	3,356,990.00	
T 2 02/15/50	2,800,000.00	2,036,776.00	
T 2 04/30/24	2,000,000.00	1,943,280.00	
T 2 05/31/24	3,300,000.00	3,201,000.00	
T 2 06/30/24	4,100,000.00	3,970,891.00	
T 2 08/15/25	3,300,000.00	3,137,310.00	
T 2 08/15/51	2,900,000.00	2,098,179.00	
T 2 11/15/26	5,000,000.00	4,673,200.00	
T 2 11/15/41	3,800,000.00	2,862,464.00	
T 2.125 02/29/24	2,000,000.00	1,950,920.00	
T 2.125 03/31/24	6,500,000.00	6,336,980.00	
T 2.125 05/15/25	600,000.00	574,500.00	
T 2.125 07/31/24	3,500,000.00	3,394,160.00	
T 2.125 09/30/24	4,000,000.00	3,872,160.00	
T 2.125 11/30/23	3,100,000.00	3,037,008.00	
T 2.125 11/30/24	2,600,000.00	2,508,584.00	
T 2.25 01/31/24	2,200,000.00	2,153,580.00	
T 2.25 02/15/27	4,400,000.00	4,145,944.00	
T 2.25 02/15/52	1,700,000.00	1,307,538.00	
T 2.25 03/31/26	13,300,000.00	12,644,310.00	
T 2.25 04/30/24	3,800,000.00	3,705,266.00	
T 2.25 05/15/41	3,000,000.00	2,376,780.00	

T 2.25 08/15/27	4,200,000.00	3,941,574.00	
T 2.25 08/15/46	2,450,000.00	1,861,020.00	
T 2.25 08/15/49	3,500,000.00	2,703,750.00	
T 2.25 10/31/24	800,000.00	775,248.00	
T 2.25 11/15/24	5,100,000.00	4,940,982.00	
T 2.25 11/15/25	4,000,000.00	3,816,560.00	
T 2.25 11/15/27	4,400,000.00	4,118,796.00	
T 2.25 12/31/23	3,000,000.00	2,939,520.00	
T 2.25 12/31/24	3,900,000.00	3,768,063.00	
T 2.375 02/15/42	2,800,000.00	2,253,104.00	
T 2.375 02/29/24	3,700,000.00	3,621,634.00	
T 2.375 03/31/29	2,800,000.00	2,604,308.00	
T 2.375 05/15/27	3,000,000.00	2,835,570.00	
T 2.375 05/15/29	2,400,000.00	2,231,424.00	
T 2.375 05/15/51	1,400,000.00	1,110,690.00	
T 2.375 08/15/24	5,600,000.00	5,456,920.00	
T 2.375 11/15/49	1,900,000.00	1,511,526.00	
T 2.5 01/31/25	3,400,000.00	3,299,564.00	
T 2.5 02/15/45	3,600,000.00	2,890,404.00	
T 2.5 02/15/46	2,900,000.00	2,320,667.00	
T 2.5 02/28/26	2,100,000.00	2,014,677.00	
T 2.5 03/31/27	3,000,000.00	2,857,260.00	
T 2.5 05/15/24	5,700,000.00	5,577,051.00	
T 2.5 05/15/46	3,600,000.00	2,875,752.00	
T 2.625 01/31/26	2,700,000.00	2,606,553.00	
T 2.625 02/15/29	1,800,000.00	1,701,828.00	
T 2.625 03/31/25	1,000,000.00	971,170.00	
T 2.625 04/15/25	2,500,000.00	2,427,725.00	
T 2.625 05/31/27	3,000,000.00	2,872,020.00	
T 2.625 07/31/29	3,500,000.00	3,306,380.00	
T 2.625 12/31/23	1,900,000.00	1,872,526.00	
T 2.625 12/31/25	1,400,000.00	1,351,000.00	
T 2.75 02/15/24	5,100,000.00	5,027,478.00	
T 2.75 02/15/28	4,800,000.00	4,596,720.00	
T 2.75 02/28/25	2,000,000.00	1,950,140.00	
T 2.75 04/30/27	2,700,000.00	2,598,210.00	
T 2.75 05/15/25	3,000,000.00	2,919,840.00	
T 2.75 05/31/29	1,400,000.00	1,331,792.00	
T 2.75 06/30/25	900,000.00	874,611.00	
T 2.75 08/15/32	500,000.00	472,380.00	
T 2.75 08/15/42	2,000,000.00	1,708,580.00	
T 2.75 08/15/47	3,300,000.00	2,776,884.00	
T 2.75 08/31/23	3,800,000.00	3,758,846.00	
T 2.75 08/31/25	2,100,000.00	2,038,470.00	



T 2.75 11/15/23	4,200,000.00	4,150,104.00	
T 2.75 11/15/42	300,000.00	255,585.00	
T 2.75 11/15/47	1,500,000.00	1,263,750.00	
T 2.875 04/30/25	400,000.00	390,280.00	
T 2.875 04/30/29	3,500,000.00	3,356,150.00	
T 2.875 05/15/28	9,000,000.00	8,657,190.00	
T 2.875 05/15/32	5,700,000.00	5,445,723.00	
T 2.875 05/15/43	2,400,000.00	2,079,552.00	
T 2.875 05/15/49	1,400,000.00	1,230,572.00	
T 2.875 05/15/52	1,400,000.00	1,243,088.00	
T 2.875 05/31/25	3,100,000.00	3,023,461.00	
T 2.875 06/15/25	2,000,000.00	1,951,560.00	
T 2.875 08/15/28	4,500,000.00	4,325,625.00	
T 2.875 08/15/45	3,300,000.00	2,832,324.00	
T 2.875 10/31/23	1,000,000.00	988,900.00	
T 2.875 11/15/46	800,000.00	687,120.00	
T 2.875 11/30/23	2,000,000.00	1,976,080.00	
T 2.875 11/30/25	2,500,000.00	2,432,025.00	
T 3 02/15/47	2,500,000.00	2,198,025.00	
T 3 02/15/48	2,400,000.00	2,125,488.00	
T 3 02/15/49	3,300,000.00	2,967,162.00	
T 3 05/15/42	800,000.00	715,248.00	
T 3 05/15/45	3,000,000.00	2,633,190.00	
T 3 05/15/47	1,800,000.00	1,585,674.00	
T 3 08/15/48	900,000.00	802,053.00	
T 3 09/30/25	1,000,000.00	977,570.00	
T 3 10/31/25	3,600,000.00	3,517,020.00	
T 3 11/15/44	3,500,000.00	3,075,065.00	
T 3 11/15/45	2,700,000.00	2,371,356.00	
T 3.125 02/15/42	1,000,000.00	914,250.00	
T 3.125 02/15/43	2,300,000.00	2,078,786.00	
T 3.125 05/15/48	2,400,000.00	2,185,296.00	
T 3.125 08/15/25	3,000,000.00	2,944,920.00	
T 3.125 08/15/44	2,300,000.00	2,066,941.00	
T 3.125 11/15/28	2,900,000.00	2,825,557.00	
T 3.25 05/15/42	1,000,000.00	930,850.00	
T 3.25 06/30/29	3,000,000.00	2,944,800.00	
T 3.375 05/15/44	500,000.00	468,630.00	
T 3.375 08/15/42	1,000,000.00	949,450.00	
T 3.375 11/15/48	3,100,000.00	2,972,838.00	
T 3.5 02/15/39	200,000.00	199,702.00	
T 3.625 02/15/44	600,000.00	585,186.00	
T 3.625 08/15/43	2,400,000.00	2,348,232.00	
T 3.75 08/15/41	1,500,000.00	1,507,380.00	

	T 3.75 11/15/43	700,000.00	697,263.00	
	T 3.875 08/15/40	500,000.00	515,625.00	
	T 4.25 05/15/39	100,000.00	109,265.00	
	T 4.25 11/15/40	600,000.00	649,452.00	
	T 4.375 05/15/40	900,000.00	994,005.00	
	T 4.375 05/15/41	300,000.00	329,343.00	
	T 4.375 11/15/39	300,000.00	332,412.00	
	T 4.5 08/15/39	300,000.00	337,827.00	
	T 4.625 02/15/40	1,100,000.00	1,256,145.00	
	T 4.75 02/15/41	900,000.00	1,037,844.00	
	T 5.25 11/15/28	500,000.00	544,725.00	
	T 5.375 02/15/31	320,000.00	364,224.00	
	T 6 02/15/26	1,000,000.00	1,071,560.00	
	T-BOND 15/11/2027	1,000,000.00	1,114,600.00	
	アメリカ・ドル小計	624,620,000.00	565,333,270.50 (81,034,870,993)	
カナダ・ドル	CAN 0.5 09/01/25	2,700,000.00	2,468,448.00	
	CAN 1 06/01/27	600,000.00	541,788.00	
	CAN 1.25 06/01/30	5,700,000.00	4,950,165.00	
	CAN 1.5 04/01/25	700,000.00	663,306.00	
	CAN 1.5 06/01/26	3,200,000.00	2,990,848.00	
	CAN 1.5 09/01/24	2,200,000.00	2,109,184.00	
	CAN 1.5 12/01/31	1,900,000.00	1,646,407.00	
	CAN 1.75 12/01/53	500,000.00	364,770.00	
	CAN 2 06/01/28	700,000.00	656,124.00	
	CAN 2 09/01/23	700,000.00	687,435.00	
	CAN 2.25 03/01/24	1,000,000.00	978,600.00	
	CAN 2.25 06/01/25	500,000.00	483,055.00	
	CAN 2.25 06/01/29	1,800,000.00	1,700,388.00	
	CAN 2.25 12/01/29	1,600,000.00	1,506,512.00	
	CAN 2.5 06/01/24	2,100,000.00	2,057,790.00	
	CAN 2.75 12/01/48	1,500,000.00	1,397,775.00	
	CAN 3.5 12/01/45	1,200,000.00	1,263,468.00	
	CAN 4 06/01/41	1,600,000.00	1,779,440.00	
	CAN 5 06/01/37	600,000.00	723,954.00	
	CAN 5.75 06/01/29	250,000.00	288,340.00	
	CAN 5.75 06/01/33	400,000.00	491,252.00	
	CANADA 2.75 12/01/64	700,000.00	639,807.00	
	カナダ・ドル小計	32,150,000.00	30,388,856.00 (3,307,826,976)	
オーストラリア・ドル	ACGB 0.25 11/21/25	800,000.00	726,784.00	
	ACGB 1.5 06/21/31	4,700,000.00	3,958,810.00	
	ACGB 1.75 06/21/51	500,000.00	315,035.00	
	ACGB 2.25 05/21/28	1,800,000.00	1,692,234.00	

	ACGB 2.5 05/21/30	2,250,000.00	2,091,937.50	
	ACGB 2.75 04/21/24	2,500,000.00	2,488,300.00	
	ACGB 2.75 06/21/35	800,000.00	717,152.00	
	ACGB 2.75 11/21/27	900,000.00	872,649.00	
	ACGB 2.75 11/21/28	200,000.00	192,232.00	
	ACGB 2.75 11/21/29	1,800,000.00	1,712,664.00	
	ACGB 3 03/21/47	1,200,000.00	1,023,828.00	
	ACGB 3 11/21/33	1,000,000.00	937,530.00	
	ACGB 3.25 04/21/25	1,300,000.00	1,300,208.00	
	ACGB 3.25 04/21/29	800,000.00	789,016.00	
	ACGB 3.25 06/21/39	2,000,000.00	1,844,140.00	
	ACGB 3.75 04/21/37	1,200,000.00	1,188,708.00	
	ACGB 4.25 04/21/26	2,150,000.00	2,217,553.00	
	ACGB 4.5 04/21/33	900,000.00	966,447.00	
	オーストラリア・ドル小計	26,800,000.00	25,035,227.50 (2,419,654,738)	
シンガ ポール・ ドル	SIGB 1.25 11/01/26	250,000.00	232,250.00	
	SIGB 1.625 07/01/31	800,000.00	707,816.00	
	SIGB 2.25 08/01/36	800,000.00	719,760.00	
	SIGB 2.625 05/01/28	800,000.00	780,800.00	
	SIGB 2.75 03/01/46	800,000.00	743,200.00	
	SIGB 2.75 04/01/42	600,000.00	562,872.00	
	SIGB 2.875 09/01/30	200,000.00	196,600.00	
	SIGB 3 09/01/24	1,000,000.00	998,760.00	
	SIGB 3.375 09/01/33	300,000.00	306,300.00	
	SIGB 3.5 03/01/27	1,500,000.00	1,524,750.00	
	シンガポール・ドル小計	7,050,000.00	6,773,108.00 (690,586,092)	
イギリ ス・ボン ド	UK TSY GILT	800,000.00	567,224.00	
	UKT 0.125 01/30/26	1,500,000.00	1,361,115.00	
	UKT 0.125 01/31/28	500,000.00	428,595.00	
	UKT 0.25 01/31/25	700,000.00	653,380.00	
	UKT 0.25 07/31/31	1,300,000.00	1,011,049.00	
	UKT 0.375 10/22/26	400,000.00	358,736.00	
	UKT 0.375 10/22/30	1,800,000.00	1,456,038.00	
	UKT 0.5 01/31/29	700,000.00	595,630.00	
	UKT 0.5 10/22/61	100,000.00	40,251.00	
	UKT 0.625 06/07/25	500,000.00	469,620.00	
	UKT 0.625 07/31/35	400,000.00	285,092.00	
	UKT 0.875 10/22/29	500,000.00	431,275.00	
	UKT 1 01/31/32	1,300,000.00	1,069,510.00	
	UKT 1 04/22/24	800,000.00	774,256.00	
	UKT 1.125 10/22/73	300,000.00	148,395.00	
UKT 1.25 07/22/27	200,000.00	183,940.00		

	UKT 1.25 07/31/51	500,000.00	301,905.00	
	UKT 1.5 07/22/26	1,100,000.00	1,038,840.00	
	UKT 1.5 07/22/47	2,000,000.00	1,345,680.00	
	UKT 1.625 10/22/28	300,000.00	277,125.00	
	UKT 1.625 10/22/54	500,000.00	329,270.00	
	UKT 1.75 01/22/49	1,250,000.00	884,175.00	
	UKT 1.75 09/07/37	100,000.00	80,348.00	
	UKT 2 09/07/25	1,100,000.00	1,069,552.00	
	UKT 2.25 09/07/23	2,700,000.00	2,677,428.00	
	UKT 2.5 07/22/65	1,600,000.00	1,341,920.00	
	UKT 2.75 09/07/24	900,000.00	894,843.00	
	UKT 3.25 01/22/44	1,600,000.00	1,533,184.00	
	UKT 3.5 01/22/45	1,250,000.00	1,243,562.50	
	UKT 3.5 07/22/68	1,300,000.00	1,393,015.00	
	UKT 3.75 07/22/52	1,200,000.00	1,272,684.00	
	UKT 4 01/22/60	1,300,000.00	1,499,758.00	
	UKT 4.25 03/07/36	900,000.00	985,617.00	
	UKT 4.25 06/07/32	500,000.00	547,100.00	
	UKT 4.25 09/07/39	600,000.00	660,516.00	
	UKT 4.25 12/07/27	900,000.00	949,320.00	
	UKT 4.25 12/07/40	600,000.00	663,090.00	
	UKT 4.25 12/07/46	1,500,000.00	1,675,605.00	
	UKT 4.25 12/07/49	900,000.00	1,019,466.00	
	UKT 4.25 12/07/55	1,700,000.00	1,996,616.00	
	UKT 4.5 09/07/34	1,100,000.00	1,229,954.00	
	UKT 4.5 12/07/42	1,050,000.00	1,202,481.00	
	UKT 4.75 12/07/30	1,150,000.00	1,294,198.50	
	UKT 4.75 12/07/38	1,000,000.00	1,166,290.00	
	UKT 5 03/07/25	1,300,000.00	1,358,721.00	
	UKT 6 12/07/28	650,000.00	756,587.00	
	イギリス・ポンド小計	44,350,000.00	42,522,957.00 (7,028,619,563)	
イスラエル・シュケル	ILGOV 0.5 04/30/25	4,500,000.00	4,219,110.00	
	ILGOV 1 03/31/30	700,000.00	602,322.00	
	ILGOV 1.5 11/30/23	2,200,000.00	2,169,948.00	
	ILGOV 2.25 09/28/28	500,000.00	477,390.00	
	ILGOV 3.75 03/31/47	3,600,000.00	3,707,712.00	
	ILGOV 6.25 10/30/26	2,600,000.00	2,919,904.00	
	イスラエル・シュケル小計	14,100,000.00	14,096,386.00 (589,548,923)	
デンマーク・クローネ	DGB 0.25 11/15/52	1,800,000.00	1,071,702.00	
	DGB 0.5 11/15/27	8,000,000.00	7,464,080.00	
	DGB 0.5 11/15/29	4,800,000.00	4,343,616.00	
	DGB 1.5 11/15/23	1,900,000.00	1,905,985.00	

	DGB 1.75 11/15/25	3,600,000.00	3,606,768.00	
	DGB 4.5 11/15/39	8,200,000.00	10,952,658.00	
	デンマーク・クローネ小計	28,300,000.00	29,344,809.00 (564,300,677)	
ノル ウェー・ クローネ	NGB 1.375 08/19/30	4,200,000.00	3,644,886.00	
	NGB 1.5 02/19/26	3,000,000.00	2,826,690.00	
	NGB 1.75 03/13/25	3,000,000.00	2,889,870.00	
	NGB 1.75 09/06/29	4,700,000.00	4,254,158.00	
	NGB 2 04/26/28	7,000,000.00	6,541,500.00	
	NGB 3 03/14/24	2,800,000.00	2,793,224.00	
	ノルウェー・クローネ小計	24,700,000.00	22,950,328.00 (326,124,161)	
スウェー デン・ク ローナ	SGB 0.75 05/12/28	3,700,000.00	3,434,118.00	
	SGB 0.75 11/12/29	5,000,000.00	4,566,600.00	
	SGB 1 11/12/26	5,800,000.00	5,510,754.00	
	SGB 1.5 11/13/23	6,400,000.00	6,348,800.00	
	SGB 2.5 05/12/25	5,000,000.00	5,009,850.00	
	SGB 3.5 03/30/39	4,600,000.00	5,667,798.00	
	スウェーデン・クローナ小計	30,500,000.00	30,537,920.00 (408,902,749)	
メキシ コ・ペソ	MBONO 10 12/05/24	32,000,000.00	32,169,920.00	
	MBONO 5.75 03/05/26	19,000,000.00	16,970,800.00	
	MBONO 7.5 06/03/27	16,000,000.00	15,006,720.00	
	MBONO 7.75 05/29/31	17,000,000.00	15,695,590.00	
	MBONO 7.75 11/23/34	18,000,000.00	16,297,920.00	
	MBONO 8 11/07/47	5,000,000.00	4,459,050.00	
	MBONO 8 12/07/23	21,000,000.00	20,507,340.00	
	MBONO 8.5 05/31/29	23,000,000.00	22,392,800.00	
	MBONO 8.5 11/18/38	40,000,000.00	37,722,800.00	
	メキシコ・ペソ小計	191,000,000.00	181,222,940.00 (1,301,108,220)	
オフショ ア・人民 元	CGB 2.24 05/25/25	12,000,000.00	12,013,800.00	
	CGB 2.26 02/24/25	22,000,000.00	22,053,680.00	
	CGB 2.47 09/02/24	26,000,000.00	26,214,760.00	
	CGB 2.48 04/15/27	9,000,000.00	9,015,750.00	
	CGB 2.69 08/12/26	51,000,000.00	51,591,090.00	
	CGB 2.8 03/24/29	14,000,000.00	14,133,420.00	
	CGB 2.91 10/14/28	23,000,000.00	23,400,430.00	
	CGB 3.02 05/27/31	42,000,000.00	42,929,880.00	
	CGB 3.72 04/12/51	18,000,000.00	19,918,980.00	
	オフショア・人民元小計	217,000,000.00	221,271,790.00 (4,547,754,846)	
マレーシ ア・リン ギット	MALAYSIA GOVT	700,000.00	702,541.00	
	MALAYSIA GOVT	1,500,000.00	1,518,045.00	
	MALAYSIA GOVT	700,000.00	704,557.00	

	MALAYSIA GOVT	800,000.00	729,832.00	
	MGS 3.502 05/31/27	5,100,000.00	5,037,933.00	
	MGS 3.955 09/15/25	3,200,000.00	3,242,400.00	
	MGS 4.498 04/15/30	6,000,000.00	6,176,640.00	
	MGS 4.736 03/15/46	6,700,000.00	6,843,447.00	
	マレーシア・リングット小計	24,700,000.00	24,955,395.00 (789,755,899)	
ポーランド・ズロチ	POLGB 0.25 10/25/26	7,000,000.00	5,449,150.00	
	POLGB 0.75 04/25/25	1,800,000.00	1,574,910.00	
	POLGB 1.25 10/25/30	6,500,000.00	4,562,675.00	
	POLGB 2.25 10/25/24	10,400,000.00	9,570,496.00	
	POLGB 2.75 04/25/28	1,600,000.00	1,349,056.00	
	ポーランド・ズロチ小計	27,300,000.00	22,506,287.00 (682,206,070)	
ユーロ	BGB 0 10/22/31	1,300,000.00	1,071,460.00	
	BGB 0.1 06/22/30	200,000.00	173,012.00	
	BGB 0.35 06/22/32	600,000.00	499,416.00	
	BGB 0.4 06/22/40	300,000.00	204,963.00	
	BGB 0.5 10/22/24	1,300,000.00	1,274,078.00	
	BGB 0.65 06/22/71	400,000.00	193,044.00	
	BGB 0.8 06/22/25	300,000.00	294,018.00	
	BGB 0.8 06/22/27	800,000.00	764,416.00	
	BGB 0.8 06/22/28	1,600,000.00	1,508,240.00	
	BGB 0.9 06/22/29	900,000.00	840,555.00	
	BGB 1 06/22/26	1,800,000.00	1,756,638.00	
	BGB 1 06/22/31	1,300,000.00	1,188,070.00	
	BGB 1.25 04/22/33	1,100,000.00	998,239.00	
	BGB 1.45 06/22/37	400,000.00	344,200.00	
	BGB 1.6 06/22/47	650,000.00	526,149.00	
	BGB 1.7 06/22/50	500,000.00	404,605.00	
	BGB 1.9 06/22/38	1,000,000.00	910,790.00	
	BGB 2.15 06/22/66	500,000.00	444,805.00	
	BGB 2.25 06/22/57	500,000.00	456,790.00	
	BGB 2.6 06/22/24	1,100,000.00	1,121,538.00	
	BGB 3 06/22/34	200,000.00	211,758.00	
	BGB 3.75 06/22/45	800,000.00	946,552.00	
	BGB 4 03/28/32	500,000.00	578,095.00	
	BGB 4.25 03/28/41	1,000,000.00	1,228,800.00	
	BGB 4.5 03/28/26	700,000.00	767,389.00	
	BGB 5 03/28/35	1,000,000.00	1,272,050.00	
BGB 5.5 03/28/28	1,100,000.00	1,313,950.00		
BTPS	2,400,000.00	2,290,584.00		
BTPS 0 12/15/24	1,300,000.00	1,228,396.00		
BTPS 0.35 02/01/25	2,400,000.00	2,276,448.00		

BTPS 0.5 02/01/26	1,000,000.00	924,060.00	
BTPS 0.65 10/15/23	700,000.00	689,451.00	
BTPS 0.85 01/15/27	1,700,000.00	1,550,077.00	
BTPS 0.9 04/01/31	2,000,000.00	1,590,820.00	
BTPS 0.95 06/01/32	1,000,000.00	769,020.00	
BTPS 0.95 08/01/30	1,800,000.00	1,471,158.00	
BTPS 0.95 09/15/27	800,000.00	718,224.00	
BTPS 0.95 12/01/31	2,600,000.00	2,031,042.00	
BTPS 1.1 04/01/27	1,800,000.00	1,644,984.00	
BTPS 1.25 12/01/26	800,000.00	745,040.00	
BTPS 1.45 03/01/36	400,000.00	297,724.00	
BTPS 1.45 05/15/25	700,000.00	677,089.00	
BTPS 1.45 11/15/24	1,800,000.00	1,761,012.00	
BTPS 1.5 06/01/25	1,900,000.00	1,840,948.00	
BTPS 1.6 06/01/26	1,200,000.00	1,145,196.00	
BTPS 1.65 12/01/30	2,200,000.00	1,887,666.00	
BTPS 1.7 09/01/51	1,500,000.00	943,785.00	
BTPS 1.85 05/15/24	3,000,000.00	2,973,240.00	
BTPS 1.85 07/01/25	1,000,000.00	975,880.00	
BTPS 2 02/01/28	3,900,000.00	3,665,376.00	
BTPS 2 12/01/25	1,300,000.00	1,267,695.00	
BTPS 2.05 08/01/27	1,500,000.00	1,424,835.00	
BTPS 2.1 07/15/26	1,000,000.00	969,640.00	
BTPS 2.2 06/01/27	900,000.00	863,613.00	
BTPS 2.25 09/01/36	500,000.00	410,235.00	
BTPS 2.45 09/01/33	1,100,000.00	955,768.00	
BTPS 2.45 09/01/50	900,000.00	669,780.00	
BTPS 2.5 11/15/25	1,200,000.00	1,187,652.00	
BTPS 2.5 12/01/24	1,300,000.00	1,299,857.00	
BTPS 2.7 03/01/47	1,550,000.00	1,247,502.00	
BTPS 2.8 03/01/67	600,000.00	463,074.00	
BTPS 2.8 12/01/28	1,600,000.00	1,551,296.00	
BTPS 2.95 09/01/38	600,000.00	527,280.00	
BTPS 3 08/01/29	1,600,000.00	1,556,080.00	
BTPS 3.1 03/01/40	500,000.00	442,285.00	
BTPS 3.25 09/01/46	1,500,000.00	1,334,100.00	
BTPS 3.35 03/01/35	850,000.00	797,359.50	
BTPS 3.45 03/01/48	1,000,000.00	915,730.00	
BTPS 3.5 03/01/30	3,400,000.00	3,401,904.00	
BTPS 3.75 09/01/24	2,300,000.00	2,357,523.00	
BTPS 3.85 09/01/49	1,100,000.00	1,070,520.00	
BTPS 4 02/01/37	2,600,000.00	2,622,594.00	
BTPS 4.5 03/01/24	1,000,000.00	1,031,370.00	
BTPS 4.5 03/01/26	1,800,000.00	1,899,810.00	

BTPS 4.75 09/01/28	2,000,000.00	2,150,040.00	
BTPS 4.75 09/01/44	800,000.00	884,424.00	
BTPS 5 03/01/25	1,000,000.00	1,056,710.00	
BTPS 5 08/01/34	2,070,000.00	2,272,549.50	
BTPS 5 08/01/39	1,800,000.00	2,025,684.00	
BTPS 5 09/01/40	1,700,000.00	1,907,468.00	
BTPS 5.75 02/01/33	1,700,000.00	1,969,093.00	
BTPS 6 05/01/31	2,200,000.00	2,583,658.00	
BTPS 6.5 11/01/27	1,700,000.00	1,972,986.00	
BTPS 7.25 11/01/26	400,000.00	468,152.00	
BTPS 9 11/01/23	300,000.00	322,533.00	
DBR 0 02/15/30	1,300,000.00	1,160,913.00	
DBR 0 02/15/32	1,600,000.00	1,373,520.00	
DBR 0 05/15/35	3,600,000.00	2,876,184.00	
DBR 0 08/15/29	2,200,000.00	1,980,660.00	
DBR 0 08/15/30	5,800,000.00	5,129,810.00	
DBR 0 08/15/31	1,500,000.00	1,303,635.00	
DBR 0 08/15/50	2,800,000.00	1,752,548.00	
DBR 0.25 02/15/27	2,300,000.00	2,186,058.00	
DBR 0.25 02/15/29	1,800,000.00	1,660,752.00	
DBR 0.25 08/15/28	1,500,000.00	1,392,300.00	
DBR 0.5 02/15/25	2,500,000.00	2,450,625.00	
DBR 0.5 02/15/26	3,100,000.00	3,010,410.00	
DBR 0.5 02/15/28	2,100,000.00	1,990,212.00	
DBR 0.5 08/15/27	1,000,000.00	955,090.00	
DBR 1 05/15/38	1,000,000.00	887,600.00	
DBR 1 08/15/24	1,300,000.00	1,294,592.00	
DBR 1 08/15/25	1,300,000.00	1,286,675.00	
DBR 1.25 08/15/48	1,450,000.00	1,319,514.50	
DBR 1.5 05/15/24	2,200,000.00	2,211,176.00	
DBR 1.75 02/15/24	2,200,000.00	2,220,944.00	
DBR 2.5 07/04/44	1,900,000.00	2,170,484.00	
DBR 2.5 08/15/46	2,400,000.00	2,783,544.00	
DBR 3.25 07/04/42	700,000.00	879,998.00	
DBR 4 01/04/37	1,800,000.00	2,298,618.00	
DBR 4.25 07/04/39	700,000.00	949,662.00	
DBR 4.75 07/04/28	1,600,000.00	1,880,688.00	
DBR 4.75 07/04/34	600,000.00	795,402.00	
DBR 4.75 07/04/40	1,450,000.00	2,104,907.00	
DBR 5.5 01/04/31	900,000.00	1,173,528.00	
DBR 5.625 01/04/28	1,000,000.00	1,206,940.00	
DBR 6.25 01/04/24	1,200,000.00	1,280,124.00	
DBR 6.25 01/04/30	500,000.00	661,915.00	
DBR 6.5 07/04/27	1,000,000.00	1,228,240.00	



FRTR 0 02/25/24	1,900,000.00	1,864,907.00	
FRTR 0 02/25/25	3,000,000.00	2,884,830.00	
FRTR 0 02/25/26	3,800,000.00	3,590,164.00	
FRTR 0 03/25/24	4,800,000.00	4,702,320.00	
FRTR 0 03/25/25	1,900,000.00	1,826,090.00	
FRTR 0 05/25/32	500,000.00	405,950.00	
FRTR 0 11/25/29	4,500,000.00	3,916,260.00	
FRTR 0 11/25/30	3,900,000.00	3,309,462.00	
FRTR 0 11/25/31	3,000,000.00	2,477,790.00	
FRTR 0.25 11/25/26	3,200,000.00	3,010,752.00	
FRTR 0.5 05/25/25	1,300,000.00	1,262,625.00	
FRTR 0.5 05/25/26	3,500,000.00	3,352,860.00	
FRTR 0.5 05/25/29	1,600,000.00	1,458,640.00	
FRTR 0.5 05/25/72	100,000.00	45,357.00	
FRTR 0.5 06/25/44	800,000.00	532,528.00	
FRTR 0.75 02/25/28	500,000.00	470,445.00	
FRTR 0.75 05/25/28	3,300,000.00	3,100,449.00	
FRTR 0.75 05/25/52	3,000,000.00	1,886,850.00	
FRTR 0.75 11/25/28	3,500,000.00	3,267,250.00	
FRTR 1 05/25/27	1,800,000.00	1,737,090.00	
FRTR 1 11/25/25	1,000,000.00	980,500.00	
FRTR 1.25 05/25/34	1,200,000.00	1,061,844.00	
FRTR 1.25 05/25/36	3,700,000.00	3,183,480.00	
FRTR 1.5 05/25/31	2,550,000.00	2,450,728.50	
FRTR 1.5 05/25/50	2,400,000.00	1,899,624.00	
FRTR 1.75 05/25/66	800,000.00	648,168.00	
FRTR 1.75 06/25/39	3,200,000.00	2,885,728.00	
FRTR 1.75 11/25/24	2,600,000.00	2,612,402.00	
FRTR 2 05/25/48	2,000,000.00	1,789,380.00	
FRTR 2.25 05/25/24	1,700,000.00	1,724,310.00	
FRTR 2.5 05/25/30	3,500,000.00	3,644,865.00	
FRTR 2.75 10/25/27	3,850,000.00	4,024,982.50	
FRTR 3.25 05/25/45	900,000.00	1,004,958.00	
FRTR 3.5 04/25/26	2,500,000.00	2,659,175.00	
FRTR 4 04/25/55	1,370,000.00	1,792,220.30	
FRTR 4 04/25/60	1,400,000.00	1,888,810.00	
FRTR 4 10/25/38	2,000,000.00	2,391,040.00	
FRTR 4.25 10/25/23	1,000,000.00	1,032,560.00	
FRTR 4.5 04/25/41	2,000,000.00	2,573,660.00	
FRTR 4.75 04/25/35	2,200,000.00	2,756,776.00	
FRTR 5.5 04/25/29	2,350,000.00	2,865,284.50	
FRTR 5.75 10/25/32	400,000.00	527,156.00	
FRTR 6 10/25/25	2,100,000.00	2,377,998.00	
IRISH 0 10/18/31	500,000.00	412,340.00	

IRISH 0.9 05/15/28	500,000.00	473,280.00	
IRISH 1 05/15/26	800,000.00	782,088.00	
IRISH 1.1 05/15/29	1,000,000.00	946,660.00	
IRISH 1.3 05/15/33	800,000.00	726,696.00	
IRISH 1.35 03/18/31	500,000.00	475,555.00	
IRISH 1.5 05/15/50	500,000.00	390,280.00	
IRISH 1.7 05/15/37	300,000.00	272,517.00	
IRISH 2 02/18/45	900,000.00	814,149.00	
IRISH 2.4 05/15/30	600,000.00	618,738.00	
IRISH 3.4 03/18/24	500,000.00	514,560.00	
IRISH 5.4 03/13/25	800,000.00	874,912.00	
NETHER 0 01/15/24	1,000,000.00	983,200.00	
NETHER 0 01/15/27	800,000.00	744,512.00	
NETHER 0 07/15/30	2,600,000.00	2,258,750.00	
NETHER 0.25 07/15/25	1,100,000.00	1,061,302.00	
NETHER 0.25 07/15/29	500,000.00	450,240.00	
NETHER 0.5 01/15/40	1,700,000.00	1,314,491.00	
NETHER 0.5 07/15/26	1,700,000.00	1,629,059.00	
NETHER 0.75 07/15/27	400,000.00	382,836.00	
NETHER 0.75 07/15/28	1,500,000.00	1,417,470.00	
NETHER 2 07/15/24	1,000,000.00	1,011,720.00	
NETHER 2.5 01/15/33	200,000.00	209,092.00	
NETHER 2.75 01/15/47	1,500,000.00	1,711,530.00	
NETHER 3.75 01/15/42	1,300,000.00	1,648,179.00	
NETHER 4 01/15/37	1,400,000.00	1,723,008.00	
NETHER 5.5 01/15/28	700,000.00	833,119.00	
OBL 0 04/05/24	1,300,000.00	1,277,965.00	
OBL 0 04/11/25	2,800,000.00	2,705,472.00	
OBL 0 04/16/27	3,300,000.00	3,083,223.00	
OBL 0 10/09/26	1,100,000.00	1,037,102.00	
OBL 0 10/10/25	1,800,000.00	1,727,874.00	
OBL 0 10/13/23	1,600,000.00	1,582,880.00	
OBL 0 10/18/24	600,000.00	584,058.00	
RAGB 0 02/20/30	900,000.00	769,356.00	
RAGB 0 02/20/31	900,000.00	749,970.00	
RAGB 0.5 02/20/29	550,000.00	498,800.50	
RAGB 0.5 04/20/27	700,000.00	660,240.00	
RAGB 0.75 02/20/28	700,000.00	656,278.00	
RAGB 0.75 03/20/51	900,000.00	590,040.00	
RAGB 0.75 10/20/26	900,000.00	865,395.00	
RAGB 0.85 06/30/20	150,000.00	68,481.00	
RAGB 0.9 02/20/32	300,000.00	264,858.00	
RAGB 1.2 10/20/25	1,000,000.00	987,270.00	
RAGB 1.5 02/20/47	700,000.00	582,568.00	

RAGB 1.5 11/02/86	200,000.00	139,104.00	
RAGB 1.65 10/21/24	800,000.00	802,984.00	
RAGB 1.75 10/20/23	1,000,000.00	1,006,020.00	
RAGB 2.4 05/23/34	900,000.00	900,954.00	
RAGB 3.15 06/20/44	700,000.00	788,606.00	
RAGB 3.8 01/26/62	700,000.00	920,283.00	
RAGB 4.15 03/15/37	300,000.00	362,868.00	
RAGB 4.85 03/15/26	500,000.00	554,415.00	
RAGB 6.25 07/15/27	1,000,000.00	1,205,020.00	
RFGB 0.25 09/15/40	400,000.00	272,860.00	
RFGB 0.5 04/15/26	800,000.00	766,728.00	
RFGB 0.5 09/15/28	400,000.00	367,552.00	
RFGB 0.5 09/15/29	800,000.00	722,120.00	
RFGB 0.75 04/15/31	500,000.00	447,505.00	
RFGB 1.375 04/15/47	300,000.00	246,960.00	
RFGB 2 04/15/24	900,000.00	909,981.00	
RFGB 2.625 07/04/42	800,000.00	818,104.00	
RFGB 2.75 07/04/28	400,000.00	418,816.00	
RFGB 4 07/04/25	300,000.00	320,451.00	
SPGB 0 01/31/25	500,000.00	479,320.00	
SPGB 0.25 07/30/24	1,400,000.00	1,363,502.00	
SPGB 0.5 04/30/30	1,000,000.00	864,770.00	
SPGB 0.5 10/31/31	1,400,000.00	1,157,828.00	
SPGB 0.7 04/30/32	2,000,000.00	1,659,060.00	
SPGB 0.8 07/30/27	1,000,000.00	937,270.00	
SPGB 1 10/31/50	300,000.00	179,784.00	
SPGB 1.2 10/31/40	1,700,000.00	1,239,045.00	
SPGB 1.25 10/31/30	3,000,000.00	2,720,910.00	
SPGB 1.3 10/31/26	3,100,000.00	3,015,401.00	
SPGB 1.4 04/30/28	1,600,000.00	1,527,920.00	
SPGB 1.4 07/30/28	2,200,000.00	2,093,102.00	
SPGB 1.45 04/30/29	2,000,000.00	1,890,140.00	
SPGB 1.45 10/31/27	600,000.00	578,394.00	
SPGB 1.45 10/31/71	400,000.00	215,184.00	
SPGB 1.5 04/30/27	1,500,000.00	1,459,305.00	
SPGB 1.6 04/30/25	1,400,000.00	1,392,734.00	
SPGB 1.85 07/30/35	2,000,000.00	1,764,940.00	
SPGB 1.95 04/30/26	2,000,000.00	1,997,840.00	
SPGB 1.95 07/30/30	1,700,000.00	1,634,006.00	
SPGB 2.15 10/31/25	1,600,000.00	1,614,768.00	
SPGB 2.35 07/30/33	700,000.00	669,886.00	
SPGB 2.7 10/31/48	750,000.00	689,752.50	
SPGB 2.75 10/31/24	2,100,000.00	2,147,460.00	
SPGB 2.9 10/31/46	1,700,000.00	1,631,252.00	

	SPGB 3.45 07/30/66	1,300,000.00	1,302,782.00	
	SPGB 3.8 04/30/24	1,400,000.00	1,448,930.00	
	SPGB 4.2 01/31/37	1,250,000.00	1,424,137.50	
	SPGB 4.4 10/31/23	1,000,000.00	1,032,500.00	
	SPGB 4.65 07/30/25	1,300,000.00	1,403,935.00	
	SPGB 4.7 07/30/41	1,500,000.00	1,839,300.00	
	SPGB 4.8 01/31/24	2,200,000.00	2,298,560.00	
	SPGB 4.9 07/30/40	1,200,000.00	1,496,532.00	
	SPGB 5.15 10/31/28	1,500,000.00	1,739,325.00	
	SPGB 5.15 10/31/44	1,000,000.00	1,322,520.00	
	SPGB 5.75 07/30/32	1,000,000.00	1,267,850.00	
	SPGB 5.9 07/30/26	500,000.00	573,750.00	
	SPGB 6 01/31/29	2,200,000.00	2,681,074.00	
	ユーロ小計	374,040,000.00	365,105,390.80 (52,199,117,723)	
国債証券合計			155,890,377,628 (155,890,377,628)	
合 計			155,890,377,628 (155,890,377,628)	

(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%	52.0%
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	1.5%	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	4.5%	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	33.1%	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

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15日現在)

(2022年9月15日現在)

資産の部

流動資産

預金	28,150,330	41,017,587
金銭信託	120,919,327	4,897,342
コール・ローン	36,956,115	126,179,422
国債証券	25,957,675,314	26,198,092,878
派生商品評価勘定	125,807,966	1,458,900
未収入金	-	193,464,307
未収利息	108,745,584	126,217,095
前払費用	16,179,898	31,571,206
流動資産合計	26,394,434,534	26,722,898,737
資産合計	26,394,434,534	26,722,898,737
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,175,922	653,700,458
未払金	-	10,299,069
未払解約金	2,500,000	251,000,000
未払利息	95	-
その他未払費用	417	292
流動負債合計	3,676,434	914,999,819
負債合計	3,676,434	914,999,819
純資産の部		
元本等		
元本	17,363,959,464	19,909,411,282
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	9,026,798,636	5,898,487,636
元本等合計	26,390,758,100	25,807,898,918
純資産合計	26,390,758,100	25,807,898,918
負債純資産合計	26,394,434,534	26,722,898,737

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年9月16日 至 2022年9月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

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

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年9月15日現在)	(2022年9月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	17,363,959,464口	19,909,411,282口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.5199円 (1万口当たりの純資産額15,199円)	1口当たり純資産額 1.2963円 (1万口当たりの純資産額12,963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16日 至 2022年9月15日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

<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15日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年9月15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 売建				
	アメリカ・ドル	11,975,159,024	-	11,913,425,524	61,733,500
	イギリス・ポンド	1,636,445,041	-	1,636,194,033	251,008
	イスラエル・シケ ル	120,802,017	-	120,199,200	602,817
	オーストラリア・ド ル	485,561,160	-	482,711,894	2,849,266
	カナダ・ドル	517,271,409	-	511,932,749	5,338,660
	シンガポール・ドル	241,569,305	-	240,615,865	953,440
	スウェーデン・ク ローナ	76,726,905	-	76,507,300	219,605
	デンマーク・クロ ーネ	134,909,117	-	134,231,100	678,017
	ノルウェー・クロ ーネ	63,160,376	-	63,184,877	24,501
	ポーランド・ズロチ	153,611,554	-	151,948,560	1,662,994
	メキシコ・ペソ	187,361,443	-	188,512,864	1,151,421
	ユーロ	10,582,515,583	-	10,530,996,924	51,518,659
	小計	26,175,092,934	-	26,050,460,890	124,632,044
	合 計	26,175,092,934	-	26,050,460,890	124,632,044

(2022年9月15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				
	カナダ・ドル	4,711	-	4,719	8
	デンマーク・クロ ーネ	19	-	19	-
	ポーランド・ズロチ	2,429	-	2,428	1
	小計	7,159	-	7,166	7
	売建				
	アメリカ・ドル	13,541,672,276	-	13,916,025,974	374,353,698
	カナダ・ドル	549,580,723	-	564,244,705	14,663,982
	オーストラリア・ド ル	406,456,151	-	413,557,844	7,101,693
	シンガポール・ドル	255,454,468	-	261,408,764	5,954,296
	イギリス・ポンド	1,207,208,805	-	1,235,086,481	27,877,676
	イスラエル・シケ ル	102,531,296	-	102,803,154	271,858



デンマーク・クローネ	97,047,660	-	99,172,341	2,124,681
ノルウェー・クローネ	53,836,115	-	54,725,150	889,035
スウェーデン・クローナ	66,863,394	-	68,607,594	1,744,200
メキシコ・ペソ	213,210,399	-	222,138,792	8,928,393
オフショア・人民元	750,597,731	-	764,605,347	14,007,616
ポーランド・ズロチ	113,293,435	-	116,390,464	3,097,029
ユーロ	8,773,243,956	-	8,964,471,364	191,227,408
小計	26,130,996,409	-	26,783,237,974	652,241,565
合計	26,131,003,568	-	26,783,245,140	652,241,558

## (注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

自 2021年9月16日
至 2022年9月15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15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	14,963,097,482円
同期中における追加設定元本額	11,177,397,764円
同期中における一部解約元本額	8,776,535,782円
2021年9月15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	886,819,868円

三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,488,687,624円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	556,977,233円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	926,758,331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	32,978,057円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)	655,738円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,339,079,645円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	820,208円
SMAM・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	5,102,138,648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>	141,277,611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>	266,955,679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>	289,265,961円
合計	17,363,959,464円

(2022年9月15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	17,363,959,464円
同期中における追加設定元本額	10,722,198,759円
同期中における一部解約元本額	8,176,746,941円
2022年9月15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	844,366,483円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	2,468,879,015円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	934,024,678円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	1,711,684,274円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	418,843,195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	61,449,209円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)	514,009,556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	19,909,411,282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	572,010.00	
		T 0.125 02/15/24	1,050,000.00	997,164.00	
		T 0.125 10/15/23	1,090,000.00	1,046,225.60	
		T 0.25 03/15/24	890,000.00	843,969.20	
		T 0.25 05/15/24	530,000.00	499,440.20	
		T 0.25 05/31/25	370,000.00	336,437.30	
		T 0.25 06/15/24	620,000.00	582,700.80	
		T 0.25 06/30/25	650,000.00	589,719.00	
		T 0.25 08/31/25	590,000.00	531,826.00	
		T 0.25 09/30/25	290,000.00	260,770.90	
		T 0.25 10/31/25	420,000.00	376,488.00	
		T 0.25 11/15/23	500,000.00	479,920.00	
		T 0.375 01/31/26	330,000.00	294,676.80	
		T 0.375 04/30/25	320,000.00	292,624.00	
		T 0.375 07/31/27	650,000.00	557,141.00	
		T 0.375 08/15/24	410,000.00	384,469.30	
		T 0.375 09/15/24	700,000.00	654,388.00	
		T 0.375 09/30/27	470,000.00	400,378.90	
		T 0.375 11/30/25	350,000.00	314,125.00	
		T 0.375 12/31/25	620,000.00	555,042.60	
		T 0.5 02/28/26	940,000.00	841,224.80	
		T 0.5 03/31/25	420,000.00	386,790.60	
		T 0.5 04/30/27	480,000.00	416,808.00	
		T 0.5 05/31/27	370,000.00	320,423.70	
		T 0.5 06/30/27	710,000.00	613,702.70	
		T 0.5 08/31/27	640,000.00	550,400.00	
		T 0.5 10/31/27	780,000.00	667,110.60	
		T 0.5 11/30/23	200,000.00	192,140.00	
		T 0.625 03/31/27	520,000.00	455,322.40	
		T 0.625 05/15/30	870,000.00	705,848.40	
		T 0.625 07/31/26	720,000.00	640,231.20	
		T 0.625 08/15/30	1,050,000.00	847,707.00	
		T 0.625 10/15/24	230,000.00	215,569.80	
		T 0.625 11/30/27	580,000.00	498,434.60	
		T 0.625 12/31/27	350,000.00	300,055.00	
		T 0.75 01/31/28	640,000.00	551,673.60	
		T 0.75 03/31/26	720,000.00	648,388.80	
		T 0.75 08/31/26	160,000.00	142,673.60	
		T 0.75 11/15/24	660,000.00	618,538.80	
		T 0.75 12/31/23	980,000.00	942,025.00	
T 0.875 01/31/24	900,000.00	864,486.00			
T 0.875 06/30/26	500,000.00	449,920.00			
T 0.875 09/30/26	340,000.00	304,164.00			

T 0.875 11/15/30	960,000.00	789,148.80	
T 1 07/31/28	650,000.00	561,457.00	
T 1 12/15/24	600,000.00	564,090.00	
T 1.125 01/15/25	500,000.00	470,310.00	
T 1.125 02/15/31	1,040,000.00	869,450.40	
T 1.125 02/28/27	280,000.00	251,277.60	
T 1.125 02/29/28	650,000.00	571,389.00	
T 1.125 05/15/40	270,000.00	178,367.40	
T 1.125 08/15/40	380,000.00	248,394.60	
T 1.125 08/31/28	490,000.00	425,491.50	
T 1.125 10/31/26	500,000.00	451,170.00	
T 1.25 03/31/28	660,000.00	582,832.80	
T 1.25 04/30/28	730,000.00	643,166.50	
T 1.25 05/15/50	530,000.00	314,104.50	
T 1.25 05/31/28	580,000.00	510,168.00	
T 1.25 06/30/28	480,000.00	421,684.80	
T 1.25 08/15/31	1,120,000.00	935,200.00	
T 1.25 08/31/24	450,000.00	428,800.50	
T 1.25 09/30/28	560,000.00	489,188.00	
T 1.25 11/30/26	400,000.00	362,248.00	
T 1.25 12/31/26	730,000.00	660,219.30	
T 1.375 01/31/25	430,000.00	406,547.80	
T 1.375 08/15/50	680,000.00	417,132.40	
T 1.375 08/31/26	470,000.00	430,195.70	
T 1.375 10/31/28	180,000.00	158,257.80	
T 1.375 11/15/31	1,010,000.00	848,793.90	
T 1.375 11/15/40	530,000.00	361,142.00	
T 1.375 12/31/28	720,000.00	632,390.40	
T 1.5 01/31/27	350,000.00	319,620.00	
T 1.5 02/15/25	260,000.00	246,144.60	
T 1.5 02/15/30	570,000.00	497,678.40	
T 1.5 08/15/26	550,000.00	505,653.50	
T 1.5 11/30/24	510,000.00	485,571.00	
T 1.5 11/30/28	380,000.00	336,045.40	
T 1.625 02/15/26	600,000.00	558,984.00	
T 1.625 05/15/26	570,000.00	529,119.60	
T 1.625 05/15/31	930,000.00	806,403.00	
T 1.625 08/15/29	420,000.00	372,355.20	
T 1.625 09/30/26	480,000.00	443,472.00	
T 1.625 10/31/23	750,000.00	731,452.50	
T 1.625 11/15/50	720,000.00	473,400.00	
T 1.625 11/30/26	650,000.00	598,507.00	
T 1.75 01/31/29	540,000.00	484,520.40	
T 1.75 06/30/24	400,000.00	385,968.00	

T 1.75 07/31/24	400,000.00	385,500.00	
T 1.75 08/15/41	640,000.00	461,446.40	
T 1.75 11/15/29	330,000.00	294,937.50	
T 1.75 12/31/24	390,000.00	372,812.70	
T 1.75 12/31/26	300,000.00	277,464.00	
T 1.875 02/15/32	1,050,000.00	920,755.50	
T 1.875 02/15/41	410,000.00	305,191.70	
T 1.875 02/15/51	730,000.00	511,963.60	
T 1.875 02/28/27	200,000.00	185,514.00	
T 1.875 02/28/29	850,000.00	768,417.00	
T 1.875 06/30/26	750,000.00	701,805.00	
T 1.875 08/31/24	300,000.00	289,428.00	
T 1.875 11/15/51	670,000.00	469,308.20	
T 2 02/15/25	660,000.00	633,032.40	
T 2 02/15/50	470,000.00	341,887.40	
T 2 04/30/24	200,000.00	194,328.00	
T 2 05/31/24	500,000.00	485,000.00	
T 2 06/30/24	600,000.00	581,106.00	
T 2 08/15/25	600,000.00	570,420.00	
T 2 08/15/51	680,000.00	491,986.80	
T 2 11/15/26	490,000.00	457,973.60	
T 2 11/15/41	590,000.00	444,435.20	
T 2.125 03/31/24	280,000.00	272,977.60	
T 2.125 05/15/25	570,000.00	545,775.00	
T 2.125 05/31/26	320,000.00	302,387.20	
T 2.125 07/31/24	410,000.00	397,601.60	
T 2.25 01/31/24	460,000.00	450,294.00	
T 2.25 02/15/27	450,000.00	424,017.00	
T 2.25 02/15/52	440,000.00	338,421.60	
T 2.25 03/31/24	1,060,000.00	1,034,984.00	
T 2.25 03/31/26	420,000.00	399,294.00	
T 2.25 04/30/24	420,000.00	409,529.40	
T 2.25 05/15/41	270,000.00	213,910.20	
T 2.25 08/15/27	570,000.00	534,927.90	
T 2.25 08/15/46	250,000.00	189,900.00	
T 2.25 08/15/49	460,000.00	355,350.00	
T 2.25 10/31/24	580,000.00	562,054.80	
T 2.25 11/15/24	500,000.00	484,410.00	
T 2.25 11/15/27	570,000.00	533,571.30	
T 2.25 12/31/23	550,000.00	538,912.00	
T 2.25 12/31/24	500,000.00	483,085.00	
T 2.375 02/15/42	530,000.00	426,480.40	
T 2.375 03/31/29	290,000.00	269,731.90	
T 2.375 04/30/26	400,000.00	381,872.00	

T 2.375 05/15/27	680,000.00	642,729.20	
T 2.375 05/15/29	600,000.00	557,856.00	
T 2.375 05/15/51	590,000.00	468,076.50	
T 2.375 08/15/24	270,000.00	263,101.50	
T 2.375 11/15/49	480,000.00	381,859.20	
T 2.5 01/31/24	450,000.00	442,192.50	
T 2.5 01/31/25	400,000.00	388,184.00	
T 2.5 02/15/45	220,000.00	176,635.80	
T 2.5 02/15/46	150,000.00	120,034.50	
T 2.5 03/31/27	310,000.00	295,250.20	
T 2.5 04/30/24	570,000.00	558,263.70	
T 2.5 05/15/24	630,000.00	616,410.90	
T 2.5 05/15/46	230,000.00	183,728.60	
T 2.625 01/31/26	430,000.00	415,117.70	
T 2.625 02/15/29	520,000.00	491,639.20	
T 2.625 03/31/25	500,000.00	485,585.00	
T 2.625 07/31/29	270,000.00	255,063.60	
T 2.625 12/31/25	510,000.00	492,150.00	
T 2.75 02/15/28	420,000.00	402,213.00	
T 2.75 02/28/25	500,000.00	487,535.00	
T 2.75 04/30/27	290,000.00	279,067.00	
T 2.75 05/15/25	320,000.00	311,449.60	
T 2.75 05/31/29	430,000.00	409,050.40	
T 2.75 06/30/25	490,000.00	476,177.10	
T 2.75 07/31/27	350,000.00	336,584.50	
T 2.75 08/15/32	260,000.00	245,637.60	
T 2.75 08/15/42	150,000.00	128,143.50	
T 2.75 08/15/47	210,000.00	176,710.80	
T 2.75 08/31/25	270,000.00	262,089.00	
T 2.75 11/15/23	900,000.00	889,308.00	
T 2.75 11/15/42	440,000.00	374,858.00	
T 2.75 11/15/47	250,000.00	210,625.00	
T 2.875 04/30/25	200,000.00	195,140.00	
T 2.875 05/15/28	500,000.00	480,955.00	
T 2.875 05/15/32	1,000,000.00	955,390.00	
T 2.875 05/15/43	290,000.00	251,279.20	
T 2.875 05/15/49	410,000.00	360,381.80	
T 2.875 05/15/52	620,000.00	550,510.40	
T 2.875 05/31/25	600,000.00	585,186.00	
T 2.875 07/31/25	300,000.00	292,452.00	
T 2.875 08/15/28	660,000.00	634,425.00	
T 2.875 08/15/45	110,000.00	94,410.80	
T 2.875 11/15/46	340,000.00	292,026.00	
T 2.875 11/30/23	900,000.00	889,236.00	

T 2.875 11/30/25	390,000.00	379,395.90	
T 3 02/15/47	120,000.00	105,505.20	
T 3 02/15/48	400,000.00	354,248.00	
T 3 02/15/49	370,000.00	332,681.80	
T 3 05/15/42	290,000.00	259,277.40	
T 3 05/15/45	290,000.00	254,541.70	
T 3 05/15/47	300,000.00	264,279.00	
T 3 06/30/24	600,000.00	591,372.00	
T 3 07/15/25	1,080,000.00	1,056,877.20	
T 3 08/15/48	510,000.00	454,496.70	
T 3 08/15/52	170,000.00	155,257.60	
T 3 09/30/25	620,000.00	606,093.40	
T 3 11/15/44	220,000.00	193,289.80	
T 3 11/15/45	300,000.00	263,484.00	
T 3.125 02/15/42	150,000.00	137,137.50	
T 3.125 02/15/43	190,000.00	171,725.80	
T 3.125 05/15/48	420,000.00	382,426.80	
T 3.125 08/15/44	320,000.00	287,574.40	
T 3.125 11/15/28	380,000.00	370,245.40	
T 3.125 11/15/41	210,000.00	192,246.60	
T 3.25 05/15/42	250,000.00	232,712.50	
T 3.25 06/30/27	280,000.00	275,416.40	
T 3.25 06/30/29	830,000.00	814,728.00	
T 3.375 05/15/44	300,000.00	281,178.00	
T 3.375 11/15/48	450,000.00	431,541.00	
T 3.5 02/15/39	180,000.00	179,731.80	
T 3.625 02/15/44	270,000.00	263,333.70	
T 3.625 08/15/43	230,000.00	225,038.90	
T 3.875 08/15/40	340,000.00	350,625.00	
T 4.25 05/15/39	170,000.00	185,750.50	
T 4.25 11/15/40	140,000.00	151,538.80	
T 4.375 02/15/38	40,000.00	44,493.60	
T 4.375 05/15/40	140,000.00	154,623.00	
T 4.375 05/15/41	620,000.00	680,642.20	
T 4.375 11/15/39	150,000.00	166,206.00	
T 4.5 02/15/36	100,000.00	112,609.00	
T 4.5 08/15/39	120,000.00	135,130.80	
T 4.625 02/15/40	100,000.00	114,195.00	
T 5.25 11/15/28	200,000.00	217,890.00	
T 5.375 02/15/31	80,000.00	91,056.00	
US TREASURY N/B	630,000.00	596,673.00	
US TREASURY N/B	520,000.00	489,080.80	
アメリカ・ドル小計	105,070,000.00	95,005,937.40 (13,618,151,067)	

カナダ・ドル	CAN 0.25 03/01/26	270,000.00	241,938.90	
	CAN 0.25 04/01/24	460,000.00	436,116.80	
	CAN 0.5 09/01/25	270,000.00	246,844.80	
	CAN 0.5 12/01/30	340,000.00	274,182.80	
	CAN 1 06/01/27	140,000.00	126,417.20	
	CAN 1.25 03/01/25	250,000.00	235,852.50	
	CAN 1.25 03/01/27	160,000.00	146,422.40	
	CAN 1.25 06/01/30	380,000.00	330,011.00	
	CAN 1.5 06/01/26	170,000.00	158,888.80	
	CAN 1.5 06/01/31	350,000.00	305,161.50	
	CAN 1.5 09/01/24	230,000.00	220,505.60	
	CAN 1.5 12/01/31	400,000.00	346,612.00	
	CAN 1.75 12/01/53	210,000.00	153,203.40	
	CAN 2 06/01/28	60,000.00	56,239.20	
	CAN 2 12/01/51	400,000.00	314,272.00	
	CAN 2.25 03/01/24	140,000.00	137,004.00	
	CAN 2.25 06/01/25	160,000.00	154,577.60	
	CAN 2.25 06/01/29	100,000.00	94,466.00	
	CAN 2.25 12/01/29	60,000.00	56,494.20	
	CAN 2.5 06/01/24	440,000.00	431,156.00	
	CAN 2.75 12/01/48	90,000.00	83,866.50	
	CAN 3.5 12/01/45	90,000.00	94,760.10	
	CAN 4 06/01/41	140,000.00	155,701.00	
	CAN 5 06/01/37	100,000.00	120,659.00	
CAN 5.75 06/01/29	90,000.00	103,802.40		
CAN 5.75 06/01/33	30,000.00	36,843.90		
CANADA 2.75 12/01/64	50,000.00	45,700.50		
カナダ・ドル小計		5,580,000.00	5,107,700.10 (555,973,156)	
オーストラリア・ドル	ACGB 0.25 11/21/24	340,000.00	319,181.80	
	ACGB 0.25 11/21/25	140,000.00	127,187.20	
	ACGB 0.5 09/21/26	160,000.00	143,035.20	
	ACGB 1 11/21/31	280,000.00	223,042.40	
	ACGB 1 12/21/30	260,000.00	212,149.60	
	ACGB 1.25 05/21/32	170,000.00	137,150.90	
	ACGB 1.5 06/21/31	290,000.00	244,267.00	
	ACGB 1.75 06/21/51	190,000.00	119,713.30	
	ACGB 1.75 11/21/32	200,000.00	167,882.00	
	ACGB 2.25 05/21/28	190,000.00	178,624.70	
	ACGB 2.5 05/21/30	150,000.00	139,462.50	
	ACGB 2.75 04/21/24	130,000.00	129,391.60	
	ACGB 2.75 05/21/41	130,000.00	109,820.10	
	ACGB 2.75 06/21/35	120,000.00	107,572.80	
ACGB 2.75 11/21/27	320,000.00	310,275.20		



	ACGB 2.75 11/21/28	110,000.00	105,727.60	
	ACGB 2.75 11/21/29	180,000.00	171,266.40	
	ACGB 3 03/21/47	140,000.00	119,446.60	
	ACGB 3 11/21/33	100,000.00	93,753.00	
	ACGB 3.25 04/21/25	180,000.00	180,028.80	
	ACGB 3.25 04/21/29	130,000.00	128,215.10	
	ACGB 3.25 06/21/39	110,000.00	101,427.70	
	ACGB 3.75 04/21/37	120,000.00	118,870.80	
	ACGB 4.25 04/21/26	170,000.00	175,341.40	
	ACGB 4.5 04/21/33	180,000.00	193,289.40	
	ACGB 4.75 04/21/27	160,000.00	169,427.20	
	オーストラリア・ドル小計	4,650,000.00	4,225,550.30 (408,399,436)	
シンガ ポール・ ドル	SIGB 1.875 03/01/50	180,000.00	137,700.00	
	SIGB 2 02/01/24	120,000.00	118,080.00	
	SIGB 2.125 06/01/26	500,000.00	483,750.00	
	SIGB 2.25 08/01/36	210,000.00	188,937.00	
	SIGB 2.375 06/01/25	100,000.00	98,150.00	
	SIGB 2.375 07/01/39	100,000.00	89,700.00	
	SIGB 2.625 05/01/28	200,000.00	195,200.00	
	SIGB 2.75 03/01/46	120,000.00	111,480.00	
	SIGB 2.75 04/01/42	100,000.00	93,812.00	
	SIGB 2.875 07/01/29	200,000.00	197,200.00	
	SIGB 2.875 09/01/30	320,000.00	314,560.00	
	SIGB 3 08/01/72	10,000.00	9,913.30	
	SIGB 3 09/01/24	230,000.00	229,714.80	
	SIGB 3.375 09/01/33	220,000.00	224,620.00	
	シンガポール・ドル小計	2,610,000.00	2,492,817.10 (254,167,633)	
イギリ ス・ボン ド	UK TSY GILT	190,000.00	134,715.70	
	UKT 0.125 01/30/26	130,000.00	117,963.30	
	UKT 0.125 01/31/24	260,000.00	249,670.20	
	UKT 0.125 01/31/28	120,000.00	102,862.80	
	UKT 0.25 01/31/25	160,000.00	149,344.00	
	UKT 0.25 07/31/31	200,000.00	155,546.00	
	UKT 0.375 10/22/26	100,000.00	89,684.00	
	UKT 0.375 10/22/30	160,000.00	129,425.60	
	UKT 0.5 01/31/29	170,000.00	144,653.00	
	UKT 0.5 10/22/61	140,000.00	56,351.40	
	UKT 0.625 06/07/25	130,000.00	122,101.20	
	UKT 0.625 07/31/35	180,000.00	128,291.40	
	UKT 0.625 10/22/50	80,000.00	40,032.80	
	UKT 0.875 01/31/46	110,000.00	64,248.80	
UKT 0.875 07/31/33	120,000.00	93,908.40		

UKT 0.875 10/22/29	100,000.00	86,255.00	
UKT 1 01/31/32	150,000.00	123,405.00	
UKT 1 04/22/24	220,000.00	212,920.40	
UKT 1.125 10/22/73	90,000.00	44,518.50	
UKT 1.25 07/22/27	270,000.00	248,319.00	
UKT 1.25 07/31/51	120,000.00	72,457.20	
UKT 1.25 10/22/41	200,000.00	138,240.00	
UKT 1.5 07/22/26	140,000.00	132,216.00	
UKT 1.5 07/22/47	150,000.00	100,926.00	
UKT 1.5 07/31/53	90,000.00	57,537.00	
UKT 1.625 10/22/28	110,000.00	101,612.50	
UKT 1.625 10/22/54	100,000.00	65,854.00	
UKT 1.625 10/22/71	130,000.00	80,628.60	
UKT 1.75 01/22/49	110,000.00	77,807.40	
UKT 1.75 07/22/57	100,000.00	67,977.00	
UKT 1.75 09/07/37	200,000.00	160,696.00	
UKT 2 09/07/25	110,000.00	106,955.20	
UKT 2.25 09/07/23	30,000.00	29,749.20	
UKT 2.5 07/22/65	140,000.00	117,418.00	
UKT 2.75 09/07/24	250,000.00	248,567.50	
UKT 3.25 01/22/44	180,000.00	172,483.20	
UKT 3.5 01/22/45	200,000.00	198,970.00	
UKT 3.5 07/22/68	170,000.00	182,163.50	
UKT 3.75 07/22/52	140,000.00	148,479.80	
UKT 4 01/22/60	110,000.00	126,902.60	
UKT 4.25 03/07/36	180,000.00	197,123.40	
UKT 4.25 06/07/32	210,000.00	229,782.00	
UKT 4.25 09/07/39	130,000.00	143,111.80	
UKT 4.25 12/07/27	130,000.00	137,124.00	
UKT 4.25 12/07/40	140,000.00	154,721.00	
UKT 4.25 12/07/46	160,000.00	178,731.20	
UKT 4.25 12/07/49	90,000.00	101,946.60	
UKT 4.25 12/07/55	170,000.00	199,661.60	
UKT 4.5 09/07/34	150,000.00	167,721.00	
UKT 4.5 12/07/42	210,000.00	240,496.20	
UKT 4.75 12/07/30	160,000.00	180,062.40	
UKT 4.75 12/07/38	110,000.00	128,291.90	
UKT 5 03/07/25	80,000.00	83,613.60	
UKT 6 12/07/28	100,000.00	116,398.00	
イギリス・ボンド小計	7,880,000.00	7,140,641.90 (1,180,276,700)	
イスラエル・シュケル	ILGOV 1 03/31/30	190,000.00	163,487.40
	ILGOV 1.3 04/30/32	120,000.00	102,080.40
	ILGOV 1.5 05/31/37	260,000.00	204,955.40

	ILGOV 1.5 11/30/23	480,000.00	473,443.20	
	ILGOV 1.75 08/31/25	230,000.00	221,802.80	
	ILGOV 2 03/31/27	140,000.00	133,789.60	
	ILGOV 2.25 09/28/28	230,000.00	219,599.40	
	ILGOV 3.75 03/31/24	120,000.00	121,411.20	
	ILGOV 3.75 03/31/47	290,000.00	298,676.80	
	ILGOV 5.5 01/31/42	90,000.00	116,163.90	
	ILGOV 6.25 10/30/26	300,000.00	336,912.00	
	イスラエル・シュケル小計	2,450,000.00	2,392,322.10 (100,053,369)	
デンマーク・クローネ	DGB 0 11/15/24	460,000.00	444,502.60	
	DGB 0 11/15/31	640,000.00	531,014.40	
	DGB 0.25 11/15/52	480,000.00	285,787.20	
	DGB 0.5 11/15/27	830,000.00	774,398.30	
	DGB 0.5 11/15/29	670,000.00	606,296.40	
	DGB 1.5 11/15/23	400,000.00	401,260.00	
	DGB 1.75 11/15/25	480,000.00	480,902.40	
	DGB 4.5 11/15/39	1,100,000.00	1,469,259.00	
	デンマーク・クローネ小計	5,060,000.00	4,993,420.30 (96,023,472)	
ノルウェー・クローネ	NGB 1.25 09/17/31	390,000.00	328,126.50	
	NGB 1.375 08/19/30	550,000.00	477,306.50	
	NGB 1.5 02/19/26	390,000.00	367,469.70	
	NGB 1.75 02/17/27	420,000.00	393,548.40	
	NGB 1.75 03/13/25	810,000.00	780,264.90	
	NGB 1.75 09/06/29	500,000.00	452,570.00	
	NGB 2 04/26/28	360,000.00	336,420.00	
	NGB 2.125 05/18/32	240,000.00	216,312.00	
	NGB 3 03/14/24	500,000.00	498,790.00	
	ノルウェー・クローネ小計	4,160,000.00	3,850,808.00 (54,719,982)	
スウェーデン・クローナ	SGB 0.125 05/12/31	540,000.00	461,219.40	
	SGB 0.75 05/12/28	700,000.00	649,698.00	
	SGB 0.75 11/12/29	560,000.00	511,459.20	
	SGB 1 11/12/26	1,030,000.00	978,633.90	
	SGB 1.5 11/13/23	750,000.00	744,000.00	
	SGB 2.25 06/01/32	500,000.00	515,445.00	
	SGB 2.5 05/12/25	800,000.00	801,576.00	
	SGB 3.5 03/30/39	340,000.00	418,924.20	
	スウェーデン・クローナ小計	5,220,000.00	5,080,955.70 (68,033,997)	
メキシコ・ペソ	MBONO 10 11/20/36	320,000.00	344,947.20	
	MBONO 10 12/05/24	2,550,000.00	2,563,540.50	
	MBONO 5 03/06/25	1,300,000.00	1,169,246.00	

	MBONO 5.75 03/05/26	3,640,000.00	3,251,248.00	
	MBONO 7.5 06/03/27	3,300,000.00	3,095,136.00	
	MBONO 7.75 05/29/31	3,840,000.00	3,545,356.80	
	MBONO 7.75 11/13/42	2,000,000.00	1,738,960.00	
	MBONO 7.75 11/23/34	1,520,000.00	1,376,268.80	
	MBONO 8 09/05/24	2,980,000.00	2,886,010.80	
	MBONO 8 11/07/47	2,390,000.00	2,131,425.90	
	MBONO 8 12/07/23	2,160,000.00	2,109,326.40	
	MBONO 8.5 05/31/29	3,670,000.00	3,573,112.00	
	MBONO 8.5 11/18/38	2,700,000.00	2,546,289.00	
	メキシコ・ペソ小計	32,370,000.00	30,330,867.40 (217,763,496)	
オフショ ア・人民 元	CGB 2.28 03/17/24	8,000,000.00	8,035,600.00	
	CGB 2.47 09/02/24	4,000,000.00	4,033,040.00	
	CGB 2.48 04/15/27	3,000,000.00	3,005,250.00	
	CGB 2.69 08/12/26	3,000,000.00	3,034,770.00	
	CGB 2.91 10/14/28	9,000,000.00	9,156,690.00	
	CGB 3.02 05/27/31	5,000,000.00	5,110,700.00	
	CGB 3.72 04/12/51	4,000,000.00	4,426,440.00	
	オフショア・人民元小計	36,000,000.00	36,802,490.00 (756,394,216)	
ポーラン ド・ズロ チ	POLGB 0.25 10/25/26	680,000.00	529,346.00	
	POLGB 0.75 04/25/25	440,000.00	384,978.00	
	POLGB 1.25 10/25/30	450,000.00	315,877.50	
	POLGB 1.75 04/25/32	150,000.00	104,820.00	
	POLGB 2.25 10/25/24	1,310,000.00	1,205,514.40	
	POLGB 2.5 07/25/26	50,000.00	43,235.00	
	POLGB 2.5 07/25/27	170,000.00	143,318.50	
	POLGB 2.75 04/25/28	50,000.00	42,158.00	
	POLGB 2.75 10/25/29	480,000.00	390,168.00	
	POLGB 3.75 05/25/27	720,000.00	642,484.80	
	ポーランド・ズロチ小計	4,500,000.00	3,801,900.20 (115,242,438)	
ユーロ	BGB 0 10/22/27	105,000.00	95,558.40	
	BGB 0 10/22/31	140,000.00	115,388.00	
	BGB 0.1 06/22/30	120,000.00	103,807.20	
	BGB 0.2 10/22/23	80,000.00	79,024.80	
	BGB 0.35 06/22/32	170,000.00	141,501.20	
	BGB 0.4 06/22/40	90,000.00	61,488.90	
	BGB 0.5 10/22/24	180,000.00	176,410.80	
	BGB 0.65 06/22/71	30,000.00	14,478.30	
	BGB 0.8 06/22/25	170,000.00	166,610.20	
	BGB 0.8 06/22/27	130,000.00	124,217.60	
	BGB 0.8 06/22/28	160,000.00	150,824.00	

BGB 0.9 06/22/29	170,000.00	158,771.50	
BGB 1 06/22/26	210,000.00	204,941.10	
BGB 1 06/22/31	160,000.00	146,224.00	
BGB 1.25 04/22/33	100,000.00	90,749.00	
BGB 1.4 06/22/53	170,000.00	123,749.80	
BGB 1.45 06/22/37	60,000.00	51,630.00	
BGB 1.6 06/22/47	100,000.00	80,946.00	
BGB 1.7 06/22/50	100,000.00	80,921.00	
BGB 1.9 06/22/38	90,000.00	81,971.10	
BGB 2.15 06/22/66	80,000.00	71,168.80	
BGB 2.6 06/22/24	170,000.00	173,328.60	
BGB 3 06/22/34	80,000.00	84,703.20	
BGB 3.75 06/22/45	90,000.00	106,487.10	
BGB 4 03/28/32	80,000.00	92,495.20	
BGB 4.25 03/28/41	180,000.00	221,184.00	
BGB 4.5 03/28/26	100,000.00	109,627.00	
BGB 5 03/28/35	170,000.00	216,248.50	
BGB 5.5 03/28/28	160,000.00	191,120.00	
BKO 0 09/15/23	70,000.00	69,339.20	
BTPS	220,000.00	209,970.20	
BTPS 0 01/30/24	240,000.00	232,692.00	
BTPS 0 04/15/24	190,000.00	183,160.00	
BTPS 0 08/01/26	240,000.00	213,890.40	
BTPS 0 11/29/23	190,000.00	185,016.30	
BTPS 0 12/15/24	60,000.00	56,695.20	
BTPS 0.25 03/15/28	100,000.00	84,712.00	
BTPS 0.35 02/01/25	170,000.00	161,248.40	
BTPS 0.45 02/15/29	290,000.00	240,418.70	
BTPS 0.5 02/01/26	170,000.00	157,090.20	
BTPS 0.5 07/15/28	250,000.00	212,437.50	
BTPS 0.6 08/01/31	290,000.00	221,510.70	
BTPS 0.65 10/15/23	160,000.00	157,588.80	
BTPS 0.85 01/15/27	240,000.00	218,834.40	
BTPS 0.9 04/01/31	210,000.00	167,036.10	
BTPS 0.95 03/01/37	190,000.00	128,345.00	
BTPS 0.95 06/01/32	220,000.00	169,184.40	
BTPS 0.95 08/01/30	180,000.00	147,115.80	
BTPS 0.95 09/15/27	210,000.00	188,533.80	
BTPS 0.95 12/01/31	200,000.00	156,234.00	
BTPS 1.1 04/01/27	50,000.00	45,694.00	
BTPS 1.25 12/01/26	270,000.00	251,451.00	
BTPS 1.35 04/01/30	240,000.00	205,099.20	
BTPS 1.45 03/01/36	190,000.00	141,418.90	
BTPS 1.45 05/15/25	200,000.00	193,454.00	

BTPS 1.45 11/15/24	250,000.00	244,585.00	
BTPS 1.5 04/30/45	130,000.00	82,690.40	
BTPS 1.5 06/01/25	430,000.00	416,635.60	
BTPS 1.6 06/01/26	230,000.00	219,495.90	
BTPS 1.65 03/01/32	240,000.00	199,824.00	
BTPS 1.65 12/01/30	210,000.00	180,186.30	
BTPS 1.7 09/01/51	140,000.00	88,086.60	
BTPS 1.8 03/01/41	280,000.00	199,766.00	
BTPS 1.85 05/15/24	330,000.00	327,056.40	
BTPS 2 02/01/28	320,000.00	300,748.80	
BTPS 2 12/01/25	220,000.00	214,533.00	
BTPS 2.05 08/01/27	280,000.00	265,969.20	
BTPS 2.1 07/15/26	250,000.00	242,410.00	
BTPS 2.15 03/01/72	50,000.00	32,451.50	
BTPS 2.15 09/01/52	70,000.00	47,819.80	
BTPS 2.2 06/01/27	180,000.00	172,722.60	
BTPS 2.25 09/01/36	170,000.00	139,479.90	
BTPS 2.45 09/01/33	150,000.00	130,332.00	
BTPS 2.45 09/01/50	150,000.00	111,630.00	
BTPS 2.45 10/01/23	160,000.00	160,617.60	
BTPS 2.5 11/15/25	240,000.00	237,530.40	
BTPS 2.5 12/01/24	130,000.00	129,985.70	
BTPS 2.7 03/01/47	150,000.00	120,726.00	
BTPS 2.8 03/01/67	90,000.00	69,461.10	
BTPS 2.8 06/15/29	130,000.00	124,407.40	
BTPS 2.8 12/01/28	200,000.00	193,912.00	
BTPS 2.95 09/01/38	100,000.00	87,880.00	
BTPS 3 08/01/29	200,000.00	194,510.00	
BTPS 3.1 03/01/40	120,000.00	106,148.40	
BTPS 3.25 03/01/38	70,000.00	63,539.00	
BTPS 3.25 09/01/46	180,000.00	160,092.00	
BTPS 3.35 03/01/35	130,000.00	121,949.10	
BTPS 3.45 03/01/48	180,000.00	164,831.40	
BTPS 3.5 03/01/30	240,000.00	240,134.40	
BTPS 3.75 09/01/24	350,000.00	358,753.50	
BTPS 3.85 09/01/49	140,000.00	136,248.00	
BTPS 4 02/01/37	250,000.00	252,172.50	
BTPS 4.5 03/01/24	70,000.00	72,195.90	
BTPS 4.5 03/01/26	210,000.00	221,644.50	
BTPS 4.75 09/01/28	140,000.00	150,502.80	
BTPS 4.75 09/01/44	170,000.00	187,940.10	
BTPS 5 03/01/25	250,000.00	264,177.50	
BTPS 5 08/01/34	220,000.00	241,527.00	
BTPS 5 08/01/39	220,000.00	247,583.60	

BTPS 5 09/01/40	180,000.00	201,967.20	
BTPS 5.25 11/01/29	250,000.00	279,285.00	
BTPS 5.75 02/01/33	270,000.00	312,738.30	
BTPS 6 05/01/31	250,000.00	293,597.50	
BTPS 6.5 11/01/27	190,000.00	220,510.20	
BTPS 9 11/01/23	170,000.00	182,768.70	
DBR 0 02/15/30	210,000.00	187,532.10	
DBR 0 02/15/31	240,000.00	210,434.40	
DBR 0 02/15/32	250,000.00	214,612.50	
DBR 0 05/15/35	200,000.00	159,788.00	
DBR 0 05/15/36	250,000.00	196,042.50	
DBR 0 08/15/26	320,000.00	303,270.40	
DBR 0 08/15/29	250,000.00	225,075.00	
DBR 0 08/15/30	430,000.00	380,313.50	
DBR 0 08/15/31	380,000.00	329,904.60	
DBR 0 08/15/50	280,000.00	175,254.80	
DBR 0 08/15/50	130,000.00	81,595.80	
DBR 0 08/15/52	170,000.00	102,144.50	
DBR 0 11/15/27	220,000.00	203,680.40	
DBR 0 11/15/28	220,000.00	200,508.00	
DBR 0.25 02/15/27	320,000.00	304,147.20	
DBR 0.25 02/15/29	250,000.00	230,660.00	
DBR 0.25 08/15/28	220,000.00	204,204.00	
DBR 0.5 02/15/25	200,000.00	196,050.00	
DBR 0.5 02/15/26	220,000.00	213,642.00	
DBR 0.5 02/15/28	230,000.00	217,975.60	
DBR 0.5 08/15/27	270,000.00	257,874.30	
DBR 1 05/15/38	100,000.00	88,760.00	
DBR 1 08/15/24	210,000.00	209,126.40	
DBR 1 08/15/25	300,000.00	296,925.00	
DBR 1.25 08/15/48	280,000.00	254,802.80	
DBR 1.5 05/15/24	390,000.00	391,981.20	
DBR 1.7 08/15/32	110,000.00	110,171.60	
DBR 1.75 02/15/24	530,000.00	535,045.60	
DBR 2.5 07/04/44	260,000.00	297,013.60	
DBR 2.5 08/15/46	300,000.00	347,943.00	
DBR 3.25 07/04/42	180,000.00	226,285.20	
DBR 4 01/04/37	260,000.00	332,022.60	
DBR 4.25 07/04/39	170,000.00	230,632.20	
DBR 4.75 07/04/28	170,000.00	199,823.10	
DBR 4.75 07/04/34	230,000.00	304,904.10	
DBR 4.75 07/04/40	220,000.00	319,365.20	
DBR 5.5 01/04/31	220,000.00	286,862.40	
DBR 5.625 01/04/28	310,000.00	374,151.40	

DBR 6.25 01/04/30	130,000.00	172,097.90	
DBR 6.5 07/04/27	160,000.00	196,518.40	
FRANCE 0.A.T.	250,000.00	153,652.50	
FRTR 0 02/25/24	300,000.00	294,459.00	
FRTR 0 02/25/26	440,000.00	415,703.20	
FRTR 0 02/25/27	350,000.00	323,736.00	
FRTR 0 03/25/24	410,000.00	401,656.50	
FRTR 0 03/25/25	510,000.00	490,161.00	
FRTR 0 05/25/32	310,000.00	251,689.00	
FRTR 0 11/25/29	400,000.00	348,112.00	
FRTR 0 11/25/30	430,000.00	364,889.40	
FRTR 0 11/25/31	480,000.00	396,446.40	
FRTR 0.25 11/25/26	360,000.00	338,709.60	
FRTR 0.5 05/25/25	490,000.00	475,912.50	
FRTR 0.5 05/25/26	480,000.00	459,820.80	
FRTR 0.5 05/25/29	570,000.00	519,640.50	
FRTR 0.5 05/25/40	310,000.00	220,158.90	
FRTR 0.5 05/25/72	80,000.00	36,285.60	
FRTR 0.5 06/25/44	120,000.00	79,879.20	
FRTR 0.75 05/25/28	710,000.00	667,066.30	
FRTR 0.75 05/25/52	280,000.00	176,106.00	
FRTR 0.75 11/25/28	500,000.00	466,750.00	
FRTR 1 05/25/27	450,000.00	434,272.50	
FRTR 1 11/25/25	450,000.00	441,225.00	
FRTR 1.25 05/25/34	340,000.00	300,855.80	
FRTR 1.25 05/25/36	390,000.00	335,556.00	
FRTR 1.5 05/25/31	480,000.00	461,313.60	
FRTR 1.5 05/25/50	340,000.00	269,113.40	
FRTR 1.75 05/25/66	120,000.00	97,225.20	
FRTR 1.75 06/25/39	300,000.00	270,537.00	
FRTR 1.75 11/25/24	600,000.00	602,862.00	
FRTR 2 05/25/48	310,000.00	277,353.90	
FRTR 2.25 05/25/24	350,000.00	355,005.00	
FRTR 2.5 05/25/30	660,000.00	687,317.40	
FRTR 2.75 10/25/27	470,000.00	491,361.50	
FRTR 3.25 05/25/45	280,000.00	312,653.60	
FRTR 3.5 04/25/26	420,000.00	446,741.40	
FRTR 4 04/25/55	200,000.00	261,638.00	
FRTR 4 04/25/60	170,000.00	229,355.50	
FRTR 4 10/25/38	270,000.00	322,790.40	
FRTR 4.25 10/25/23	340,000.00	351,070.40	
FRTR 4.5 04/25/41	350,000.00	450,390.50	
FRTR 4.75 04/25/35	300,000.00	375,924.00	
FRTR 5.5 04/25/29	340,000.00	414,551.80	



FRTR 5.75 10/25/32	440,000.00	579,871.60	
FRTR 6 10/25/25	180,000.00	203,828.40	
IRISH 0 10/18/31	100,000.00	82,468.00	
IRISH 0.2 05/15/27	60,000.00	55,780.20	
IRISH 0.2 10/18/30	40,000.00	34,503.60	
IRISH 0.35 10/18/32	50,000.00	41,395.50	
IRISH 0.4 05/15/35	40,000.00	31,429.20	
IRISH 0.9 05/15/28	80,000.00	75,724.80	
IRISH 1 05/15/26	120,000.00	117,313.20	
IRISH 1.1 05/15/29	100,000.00	94,666.00	
IRISH 1.3 05/15/33	50,000.00	45,418.50	
IRISH 1.35 03/18/31	60,000.00	57,066.60	
IRISH 1.5 05/15/50	70,000.00	54,639.20	
IRISH 1.7 05/15/37	70,000.00	63,587.30	
IRISH 2 02/18/45	100,000.00	90,461.00	
IRISH 2.4 05/15/30	100,000.00	103,123.00	
IRISH 3.4 03/18/24	80,000.00	82,329.60	
IRISH 5.4 03/13/25	100,000.00	109,364.00	
IRISH GOVT	50,000.00	35,295.00	
NETHER 0 01/15/24	140,000.00	137,648.00	
NETHER 0 01/15/26	60,000.00	56,913.00	
NETHER 0 01/15/27	150,000.00	139,596.00	
NETHER 0 01/15/29	110,000.00	98,036.40	
NETHER 0 01/15/38	80,000.00	58,012.00	
NETHER 0 01/15/52	130,000.00	72,131.80	
NETHER 0 07/15/30	120,000.00	104,250.00	
NETHER 0 07/15/31	140,000.00	119,004.20	
NETHER 0.25 07/15/25	210,000.00	202,612.20	
NETHER 0.25 07/15/29	130,000.00	117,062.40	
NETHER 0.5 01/15/40	160,000.00	123,716.80	
NETHER 0.5 07/15/26	160,000.00	153,323.20	
NETHER 0.5 07/15/32	100,000.00	86,773.00	
NETHER 0.75 07/15/27	170,000.00	162,705.30	
NETHER 0.75 07/15/28	140,000.00	132,297.20	
NETHER 2 07/15/24	170,000.00	171,992.40	
NETHER 2.5 01/15/33	140,000.00	146,364.40	
NETHER 2.75 01/15/47	200,000.00	228,204.00	
NETHER 3.75 01/15/42	160,000.00	202,852.80	
NETHER 4 01/15/37	180,000.00	221,529.60	
NETHER 5.5 01/15/28	140,000.00	166,623.80	
OBL 0 04/05/24	410,000.00	403,050.50	
OBL 0 04/10/26	210,000.00	200,144.70	
OBL 0 04/11/25	190,000.00	183,585.60	
OBL 0 04/16/27	150,000.00	140,146.50	

OBL 0 10/09/26	170,000.00	160,279.40	
OBL 0 10/10/25	310,000.00	298,083.60	
OBL 0 10/13/23	200,000.00	197,860.00	
OBL 0 10/18/24	310,000.00	301,763.30	
RAGB 0 02/20/30	120,000.00	102,580.80	
RAGB 0 02/20/31	100,000.00	83,330.00	
RAGB 0 04/20/25	90,000.00	86,289.30	
RAGB 0 07/15/24	160,000.00	156,041.60	
RAGB 0 10/20/28	30,000.00	26,511.60	
RAGB 0 10/20/40	50,000.00	31,735.00	
RAGB 0.25 10/20/36	110,000.00	81,402.20	
RAGB 0.5 02/20/29	110,000.00	99,760.10	
RAGB 0.5 04/20/27	150,000.00	141,480.00	
RAGB 0.7 04/20/71	50,000.00	25,730.00	
RAGB 0.75 02/20/28	130,000.00	121,880.20	
RAGB 0.75 03/20/51	80,000.00	52,448.00	
RAGB 0.75 10/20/26	150,000.00	144,232.50	
RAGB 0.9 02/20/32	100,000.00	88,286.00	
RAGB 1.2 10/20/25	100,000.00	98,727.00	
RAGB 1.5 02/20/47	70,000.00	58,256.80	
RAGB 1.5 11/02/86	100,000.00	69,552.00	
RAGB 1.65 10/21/24	80,000.00	80,298.40	
RAGB 1.75 10/20/23	80,000.00	80,481.60	
RAGB 1.85 05/23/49	50,000.00	44,123.00	
RAGB 2.4 05/23/34	60,000.00	60,063.60	
RAGB 3.15 06/20/44	50,000.00	56,329.00	
RAGB 3.8 01/26/62	50,000.00	65,734.50	
RAGB 4.15 03/15/37	140,000.00	169,338.40	
RAGB 4.85 03/15/26	100,000.00	110,883.00	
RAGB 6.25 07/15/27	80,000.00	96,401.60	
RFGB 0 09/15/23	30,000.00	29,589.30	
RFGB 0 09/15/24	60,000.00	58,276.80	
RFGB 0 09/15/26	40,000.00	37,239.20	
RFGB 0 09/15/30	70,000.00	59,426.50	
RFGB 0.125 04/15/36	40,000.00	29,605.20	
RFGB 0.125 04/15/52	20,000.00	10,659.80	
RFGB 0.125 09/15/31	40,000.00	33,466.80	
RFGB 0.25 09/15/40	50,000.00	34,107.50	
RFGB 0.5 04/15/26	70,000.00	67,088.70	
RFGB 0.5 04/15/43	30,000.00	20,554.20	
RFGB 0.5 09/15/27	40,000.00	37,469.20	
RFGB 0.5 09/15/28	80,000.00	73,510.40	
RFGB 0.5 09/15/29	50,000.00	45,132.50	
RFGB 0.75 04/15/31	60,000.00	53,700.60	

RFGB 0.875 09/15/25	100,000.00	97,825.00	
RFGB 1.125 04/15/34	50,000.00	43,804.00	
RFGB 1.375 04/15/47	50,000.00	41,160.00	
RFGB 1.5 09/15/32	50,000.00	46,674.00	
RFGB 2.625 07/04/42	60,000.00	61,357.80	
RFGB 2.75 07/04/28	100,000.00	104,704.00	
SPGB 0 01/31/25	290,000.00	278,005.60	
SPGB 0 01/31/26	210,000.00	196,543.20	
SPGB 0 01/31/27	210,000.00	191,261.70	
SPGB 0 01/31/28	200,000.00	177,324.00	
SPGB 0 05/31/24	230,000.00	223,780.80	
SPGB 0 05/31/25	210,000.00	199,344.60	
SPGB 0.1 04/30/31	270,000.00	218,470.50	
SPGB 0.25 07/30/24	180,000.00	175,307.40	
SPGB 0.5 04/30/30	180,000.00	155,658.60	
SPGB 0.5 10/31/31	200,000.00	165,404.00	
SPGB 0.6 10/31/29	220,000.00	194,178.60	
SPGB 0.7 04/30/32	150,000.00	124,429.50	
SPGB 0.8 07/30/27	240,000.00	224,944.80	
SPGB 0.85 07/30/37	120,000.00	87,711.60	
SPGB 1 07/30/42	100,000.00	68,803.00	
SPGB 1 10/31/50	190,000.00	113,863.20	
SPGB 1.2 10/31/40	230,000.00	167,635.50	
SPGB 1.25 10/31/30	240,000.00	217,672.80	
SPGB 1.3 10/31/26	250,000.00	243,177.50	
SPGB 1.4 04/30/28	280,000.00	267,386.00	
SPGB 1.4 07/30/28	180,000.00	171,253.80	
SPGB 1.45 04/30/29	230,000.00	217,366.10	
SPGB 1.45 10/31/27	180,000.00	173,518.20	
SPGB 1.45 10/31/71	70,000.00	37,657.20	
SPGB 1.5 04/30/27	190,000.00	184,845.30	
SPGB 1.6 04/30/25	200,000.00	198,962.00	
SPGB 1.85 07/30/35	200,000.00	176,494.00	
SPGB 1.9 10/31/52	100,000.00	73,538.00	
SPGB 1.95 04/30/26	390,000.00	389,578.80	
SPGB 1.95 07/30/30	300,000.00	288,354.00	
SPGB 2.15 10/31/25	160,000.00	161,476.80	
SPGB 2.35 07/30/33	160,000.00	153,116.80	
SPGB 2.55 10/31/32	110,000.00	107,334.70	
SPGB 2.7 10/31/48	160,000.00	147,147.20	
SPGB 2.75 10/31/24	230,000.00	235,198.00	
SPGB 2.9 10/31/46	150,000.00	143,934.00	
SPGB 3.45 07/30/66	130,000.00	130,278.20	
SPGB 3.8 04/30/24	80,000.00	82,796.00	

	SPGB 4.2 01/31/37	200,000.00	227,862.00	
	SPGB 4.4 10/31/23	300,000.00	309,750.00	
	SPGB 4.65 07/30/25	140,000.00	151,193.00	
	SPGB 4.7 07/30/41	200,000.00	245,240.00	
	SPGB 4.8 01/31/24	140,000.00	146,272.00	
	SPGB 4.9 07/30/40	180,000.00	224,479.80	
	SPGB 5.15 10/31/28	250,000.00	289,887.50	
	SPGB 5.15 10/31/44	160,000.00	211,603.20	
	SPGB 5.75 07/30/32	220,000.00	278,927.00	
	SPGB 5.9 07/30/26	110,000.00	126,225.00	
	SPGB 6 01/31/29	210,000.00	255,920.70	
	ユーロ小計	63,755,000.00	61,361,781.60 (8,772,893,915)	
国債証券合計			26,198,092,878 (26,198,092,878)	
合 計			26,198,092,878 (26,198,092,878)	

(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%	52.0%
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	0.4%	0.4%
ユーロ	国債証券	330銘柄	34.0%	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。

**【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16日から2023年3月15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・資産最適化ファンド（1 安定重視型）】

## （1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 (2022年 9月15日現在)	第6期中間計算期間 (2023年 3月15日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
預金	1,257,669	4,669,828
金銭信託	4,663,211	5,176,113
コール・ローン	120,147,047	141,182,755
投資証券	162,750,736	159,682,755
親投資信託受益証券	7,694,108,594	8,478,116,584
流動資産合計	7,982,927,257	8,788,828,035
<b>資産合計</b>		
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	9,403,696	12,568,919
未払受託者報酬	1,245,827	1,347,206
未払委託者報酬	35,299,647	38,172,427
その他未払費用	249,297	269,576
流動負債合計	46,198,467	52,358,128
<b>負債合計</b>		
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	7,722,564,936	8,737,399,768
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	214,163,854	929,861
（分配準備積立金）	305,853,457	289,235,447
元本等合計	7,936,728,790	8,736,469,907
<b>純資産合計</b>		
	7,936,728,790	8,736,469,907
<b>負債純資産合計</b>		
	7,982,927,257	8,788,828,035

## (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16日 至 2022年 3月15日	第6期中間計算期間 自 2022年 9月16日 至 2023年 3月15日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	1,222,736	3,473,936
受取利息	670	15,193
有価証券売買等損益	309,511,731	171,089,757
為替差損益	5,269,567	9,899,307
営業収益合計	303,018,758	177,499,935
<b>営業費用</b>		
支払利息	21,697	26,715
受託者報酬	1,089,394	1,347,206
委託者報酬	30,867,626	38,172,427
その他費用	230,068	280,267
営業費用合計	32,208,785	39,826,615
営業利益又は営業損失( )	335,227,543	217,326,550
経常利益又は経常損失( )	335,227,543	217,326,550
中間純利益又は中間純損失( )	335,227,543	217,326,550
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( )	9,195,464	9,784,943
期首剰余金又は期首欠損金( )	540,423,775	214,163,854
剰余金増加額又は欠損金減少額	152,051,085	4,226,889
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	152,051,085	4,226,889
剰余金減少額又は欠損金増加額	53,972,563	11,778,997
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	53,972,563	11,778,997
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( )	312,470,218	929,861

## (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16日 至 2023年3月15日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>	

## (中間貸借対照表に関する注記)

項目	第5期	第6期中間計算期間
	(2022年9月15日現在)	(2023年3月15日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	7,722,564,936口	8,737,399,768口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	元本の欠損 929,861円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0277円 (1万口当たりの純資産額10,277円)	1口当たり純資産額 0.9999円 (1万口当たりの純資産額9,999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15日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(投資証券、親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

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15日現在)	第6期中間計算期間 (2023年3月15日現在)
期首元本額	5,474,513,206円	7,722,564,936円
期中追加設定元本額	3,272,525,772円	1,468,004,978円
期中一部解約元本額	1,024,474,042円	453,170,146円

## 【三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第5期 (2022年 9月15日現在)	第6期中間計算期間 (2023年 3月15日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
預金	1,045,388	3,615,005
金銭信託	2,168,079	2,407,912
コール・ローン	55,860,282	65,677,780
投資証券	120,417,572	127,269,980
親投資信託受益証券	3,803,099,943	4,205,378,919
流動資産合計	3,982,591,264	4,404,349,596
<b>資産合計</b>		
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	963,313	4,188,529
未払受託者報酬	614,644	675,090
未払委託者報酬	17,416,340	19,128,770
その他未払費用	122,964	135,056
流動負債合計	19,117,261	24,127,445
<b>負債合計</b>		
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	3,502,252,280	3,981,636,361
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	461,221,723	398,585,790
(分配準備積立金)	261,960,471	249,226,851
元本等合計	3,963,474,003	4,380,222,151
<b>純資産合計</b>		
	3,963,474,003	4,380,222,151
<b>負債純資産合計</b>	<b>3,982,591,264</b>	<b>4,404,349,596</b>

## (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16日 至 2022年 3月15日	第6期中間計算期間 自 2022年 9月16日 至 2023年 3月15日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	1,187,563	2,621,707
受取利息	313	11,721
有価証券売買等損益	168,540,517	87,311,339
為替差損益	5,037,816	7,346,569
営業収益合計	162,314,825	92,024,480
<b>営業費用</b>		
支払利息	10,237	12,858
受託者報酬	532,123	675,090
委託者報酬	15,077,745	19,128,770
その他費用	117,011	144,020
営業費用合計	15,737,116	19,960,738
営業利益又は営業損失( )	178,051,941	111,985,218
経常利益又は経常損失( )	178,051,941	111,985,218
中間純利益又は中間純損失( )	178,051,941	111,985,218
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( )	1,955,187	3,771,501
期首剰余金又は期首欠損金( )	443,500,645	461,221,723
剰余金増加額又は欠損金減少額	120,078,815	69,635,551
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	120,078,815	69,635,551
剰余金減少額又は欠損金増加額	32,873,050	24,057,767
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	32,873,050	24,057,767
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( )	354,609,656	398,585,790

## （ 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16日 至 2023年3月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## （中間貸借対照表に関する注記）

項 目	第5期 (2022年9月15日現在)	第6期中間計算期間 (2023年3月15日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	3,502,252,280口	3,981,636,361口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1317円 (1万口当たりの純資産額11,317円)	1口当たり純資産額 1.1001円 (1万口当たりの純資産額11,001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15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(投資証券、親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (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15日現在)	第6期中間計算期間 (2023年3月15日現在)
期首元本額	2,505,245,716円	3,502,252,280円
期中追加設定元本額	1,327,482,394円	665,338,792円
期中一部解約元本額	330,475,830円	185,954,711円

## 【三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）】

## （1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 (2022年 9月15日現在)	第6期中間計算期間 (2023年 3月15日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
預金	3,640,586	12,757,597
金銭信託	5,679,420	6,374,466
コール・ローン	146,329,563	173,868,813
投資証券	412,402,253	451,728,112
親投資信託受益証券	9,786,805,117	11,036,773,488
流動資産合計	10,354,856,939	11,681,502,476
<b>資産合計</b>		
	10,354,856,939	11,681,502,476
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	6,181,920	10,002,168
未払受託者報酬	1,567,833	1,781,718
未払委託者報酬	44,423,140	50,483,250
その他未払費用	313,749	356,524
流動負債合計	52,486,642	62,623,660
<b>負債合計</b>		
	52,486,642	62,623,660
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	8,267,467,501	9,607,452,890
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,034,902,796	2,011,425,926
（分配準備積立金）	880,136,329	849,055,622
元本等合計	10,302,370,297	11,618,878,816
<b>純資産合計</b>		
	10,302,370,297	11,618,878,816
<b>負債純資産合計</b>		
	10,354,856,939	11,681,502,476

## (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16日 至 2022年 3月15日	第6期中間計算期間 自 2022年 9月16日 至 2023年 3月15日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	4,337,363	9,298,151
受取利息	814	40,923
有価証券売買等損益	463,972,675	243,559,069
為替差損益	18,695,597	26,690,239
営業収益合計	440,938,901	260,910,234
<b>営業費用</b>		
支払利息	24,201	34,306
受託者報酬	1,298,677	1,781,718
委託者報酬	36,796,901	50,483,250
その他費用	280,556	382,318
営業費用合計	38,400,335	52,681,592
営業利益又は営業損失( )	479,339,236	313,591,826
経常利益又は経常損失( )	479,339,236	313,591,826
中間純利益又は中間純損失( )	479,339,236	313,591,826
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( )	5,193,876	8,087,399
期首剰余金又は期首欠損金( )	1,487,867,307	2,034,902,796
剰余金増加額又は欠損金減少額	453,761,259	359,981,583
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	453,761,259	359,981,583
剰余金減少額又は欠損金増加額	108,642,102	77,954,026
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	108,642,102	77,954,026
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	1,358,841,104	2,011,425,926

## ( 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16日 至 2023年3月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## ( 中間貸借対照表に関する注記 )

項 目	第5期 ( 2022年9月15日現在 )	第6期中間計算期間 ( 2023年3月15日現在 )
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	8,267,467,501口	9,607,452,890口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2461円 ( 1万口当たりの純資産額12,461円 )	1口当たり純資産額 1.2094円 ( 1万口当たりの純資産額12,094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15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(投資証券、親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (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15日現在)	第6期中間計算期間 (2023年3月15日現在)
期首元本額	5,616,043,882円	8,267,467,501円
期中追加設定元本額	3,415,030,451円	1,660,178,027円
期中一部解約元本額	763,606,832円	320,192,638円

## 【三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第5期 (2022年 9月15日現在)	第6期中間計算期間 (2023年 3月15日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	2,197,443	7,365,410
金銭信託	2,499,260	2,961,152
コール・ローン	64,393,113	80,767,851
投資証券	235,552,606	257,957,829
親投資信託受益証券	4,349,539,379	4,886,203,066
未収入金	5,000,000	6,000,000
流動資産合計	4,659,181,801	5,241,255,308
資産合計	4,659,181,801	5,241,255,308
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	7,830,467	14,078,317
未払受託者報酬	694,909	806,364
未払委託者報酬	19,690,349	22,848,070
その他未払費用	139,029	161,329
流動負債合計	28,354,754	37,894,080
負債合計	28,354,754	37,894,080
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,461,108,415	4,015,892,330
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	1,169,718,632	1,187,468,898
(分配準備積立金)	424,973,670	401,282,210
元本等合計	4,630,827,047	5,203,361,228
純資産合計	4,630,827,047	5,203,361,228
負債純資産合計	4,659,181,801	5,241,255,308

## （ 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16日 至 2022年 3月15日	第6期中間計算期間 自 2022年 9月16日 至 2023年 3月15日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	2,500,072	5,278,165
受取利息	367	23,744
有価証券売買等損益	225,334,410	116,820,542
為替差損益	10,597,814	15,011,428
営業収益合計	212,236,157	126,530,061
<b>営業費用</b>		
支払利息	11,499	15,418
受託者報酬	556,232	806,364
委託者報酬	15,760,930	22,848,070
その他費用	130,618	178,329
営業費用合計	16,459,279	23,848,181
営業利益又は営業損失（ ）	228,695,436	150,378,242
経常利益又は経常損失（ ）	228,695,436	150,378,242
中間純利益又は中間純損失（ ）	228,695,436	150,378,242
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（ ）	2,200,610	6,304,384
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	724,649,642	1,169,718,632
剰余金増加額又は欠損金減少額	280,763,039	234,100,801
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	280,763,039	234,100,801
剰余金減少額又は欠損金増加額	70,328,639	72,276,677
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	70,328,639	72,276,677
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（ ）	708,589,216	1,187,468,898

## (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16日 至 2023年3月15日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>	

## (中間貸借対照表に関する注記)

項目	第5期	第6期中間計算期間
	(2022年9月15日現在)	(2023年3月15日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	3,461,108,415口	4,015,892,330口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.3380円 (1万口当たりの純資産額13,380円)	1口当たり純資産額 1.2957円 (1万口当たりの純資産額12,957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15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(投資証券、親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (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15日現在)	第6期中間計算期間 (2023年3月15日現在)
期首元本額	2,196,287,325円	3,461,108,415円
期中追加設定元本額	1,638,627,128円	771,225,588円
期中一部解約元本額	373,806,038円	216,441,673円

## 【三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）】

## （1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 （2022年 9月15日現在）	第6期中間計算期間 （2023年 3月15日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	2,630,775	8,760,738
金銭信託	2,598,956	2,826,546
コール・ローン	66,961,766	77,096,381
投資証券	278,262,227	304,976,288
親投資信託受益証券	4,254,947,241	4,785,527,360
未収入金	26,000,000	-
流動資産合計	4,631,400,965	5,179,187,313
資産合計	4,631,400,965	5,179,187,313
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	32,201,148	4,214,664
未払受託者報酬	687,701	794,893
未払委託者報酬	19,486,277	22,523,306
その他未払費用	137,588	159,032
流動負債合計	52,512,714	27,691,895
負債合計	52,512,714	27,691,895
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,255,045,332	3,784,314,130
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,323,842,919	1,367,181,288
（分配準備積立金）	504,262,684	472,688,968
元本等合計	4,578,888,251	5,151,495,418
純資産合計	4,578,888,251	5,151,495,418
負債純資産合計	4,631,400,965	5,179,187,313

## (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16日 至 2022年 3月15日	第6期中間計算期間 自 2022年 9月16日 至 2023年 3月15日
<b>営業収益</b>		
受取配当金	3,129,930	6,262,015
受取利息	357	28,249
有価証券売買等損益	250,805,470	117,198,104
為替差損益	12,867,491	17,592,877
営業収益合計	234,807,692	128,500,717
<b>営業費用</b>		
支払利息	11,349	15,305
受託者報酬	548,764	794,893
委託者報酬	15,549,695	22,523,306
その他費用	130,502	180,068
営業費用合計	16,240,310	23,513,572
営業利益又は営業損失( )	251,048,002	152,014,289
経常利益又は経常損失( )	251,048,002	152,014,289
中間純利益又は中間純損失( )	251,048,002	152,014,289
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( )	1,465,766	6,626,192
期首剰余金又は期首欠損金( )	799,282,912	1,323,842,919
剰余金増加額又は欠損金減少額	310,974,157	280,986,359
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	310,974,157	280,986,359
剰余金減少額又は欠損金増加額	88,051,316	92,259,893
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	88,051,316	92,259,893
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( )	772,623,517	1,367,181,288

## （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16日 至 2023年3月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## （中間貸借対照表に関する注記）

項目	第5期 (2022年9月15日現在)	第6期中間計算期間 (2023年3月15日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	3,255,045,332口	3,784,314,130口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.4067円 (1万口当たりの純資産額14,067円)	1口当たり純資産額 1.3613円 (1万口当たりの純資産額13,613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15日現在)



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

## (デリバティブ取引に関する注記)

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15日現在)	第6期中間計算期間 (2023年3月15日現在)
期首元本額	2,129,655,362円	3,255,045,332円
期中追加設定元本額	1,564,567,682円	758,688,628円
期中一部解約元本額	439,177,712円	229,419,830円

## (参考)

「三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)」、「三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)」、「三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)」、「三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)」および「三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)」は、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「エマージング株式インデックス・マザーファンド」、「Jリート・インデックス・マザーファンド」、「外国リート・インデックス・マザーファンド」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」および「ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。  
なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

## 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

## (1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2022年9月15日現在)	(2023年3月15日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	127,108,074	59,913,938
コール・ローン	3,274,923,761	1,634,202,082
株式	211,443,637,940	222,583,667,670
派生商品評価勘定	34,489,000	-
未収入金	80,311,086	-
未収配当金	94,269,554	403,900,474
前払金	-	83,930,000
差入委託証拠金	136,125,000	68,850,000

流動資産合計	215,190,864,415	224,834,464,164
資産合計	215,190,864,415	224,834,464,164
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	7,389,700	64,597,900
前受金	17,130,000	-
未払解約金	92,522,517	417,032,407
その他未払費用	3,957	3,025
流動負債合計	117,046,174	481,633,332
負債合計	117,046,174	481,633,332
純資産の部		
元本等		
元本	64,962,611,793	66,558,621,179
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	150,111,206,448	157,794,209,653
元本等合計	215,073,818,241	224,352,830,832
純資産合計	215,073,818,241	224,352,830,832
負債純資産合計	215,190,864,415	224,834,464,164

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年9月16日 至 2023年3月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（2022年9月15日現在）	（2023年3月15日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	64,962,611,793口	66,558,621,179口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.3107円 （1万口当たりの純資産額33,107円）	1口当たり純資産額 3.3708円 （1万口当たりの純資産額33,708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15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15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	3,587,610,700	-	3,614,710,000	27,099,300
	小計	3,587,610,700	-	3,614,710,000	27,099,300
合計		3,587,610,700	-	3,614,710,000	27,099,300

（2023年3月15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	1,792,087,900	-	1,727,490,000	64,597,900
	小計	1,792,087,900	-	1,727,490,000	64,597,900
合計		1,792,087,900	-	1,727,490,000	64,597,900

（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15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	60,058,250,145円
同期中における追加設定元本額	12,180,948,100円
同期中における一部解約元本額	7,276,586,452円
2022年9月15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	9,518,027,852円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	1,024,145,291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)	62,318,872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)	260,505,626円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,389,634,617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	21,281,199,609円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	131,058,857円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	212,157,060円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	139,804,903円
イオン・バランス戦略ファンド	24,182,335円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	38,184,508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)	358,413,998円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	411,029,732円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	48,938,329円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	754,991,152円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	39,292,044円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	191,390,450円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	182,254,034円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	5,290,169円
日興F W S・日本株インデックス	1,185,822,718円
三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド	14,503,710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)	2,657,529,792円

バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	12,860,629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 >	37,699,412円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 >	43,674,328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 >	104,336,158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 >	54,212,383円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2 < 適格機関投資家専用 >	38,507,732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 >	42,112,383円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2 < 適格機関投資家専用 >	564,257,278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)	174,943,931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	64,962,611,793円

(2023年3月15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	64,962,611,793円
同期中における追加設定元本額	5,564,999,254円
同期中における一部解約元本額	3,968,989,868円
2023年3月15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	9,532,895,495円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	1,037,840,802円

三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,603,990,279円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,621,091,027円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	147,546,296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)	63,842,476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)	154,067,988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)	1,351,826,233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	23,235,049,788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	55,912,338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)	392,021,567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	53,835,423円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	881,847,675円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	40,281,652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)	214,648,071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	1,518,092,556円
三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド	27,142,175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)	2,518,408,302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>	15,174,904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>	1,292,137,581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>	1,366,728,872円
S M A M・バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	5,225,682,111円
S M A M・バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	35,485,948円
S M A M・バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定>	129,345,747円
S M A M・バランスファンドV A 7 5 <適格機関投資家専用>	632,234,488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>	43,533,209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>	227,367,598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>	733,752,353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>	508,558,770円
S M A M・バランスファンドV A 3 5 <適格機関投資家専用>	1,532,582,619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>	33,890,465円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	37,753,776円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	29,661,169円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	15,809,789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>	500,302,573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)	162,657,264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>	78,463,864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>	38,854,455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	66,558,621,179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15日現在)	(2023年3月15日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	7,511,586,557	3,044,302,370
金銭信託	13,279,106	101,321,152
コール・ローン	342,134,530	2,763,618,023
株式	409,623,622,949	436,402,330,582
投資証券	10,830,115,492	10,437,215,986
派生商品評価勘定	1,139,620	149,992,065
未収入金	245,407,071	1,144,228
未収配当金	746,532,782	808,648,748
差入委託証拠金	2,866,215,725	2,691,998,755
流動資産合計	432,180,033,832	456,400,571,909
資産合計	432,180,033,832	456,400,571,909
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	409,947,031	13,873,508

未払金	-	26,591,077
未払解約金	487,613,402	137,147,803
その他未払費用	1,829	1,333
流動負債合計	897,562,262	177,613,721
負債合計	897,562,262	177,613,721
純資産の部		
元本等		
元本	69,478,969,425	76,032,660,782
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	361,803,502,145	380,190,297,406
元本等合計	431,282,471,570	456,222,958,188
純資産合計	431,282,471,570	456,222,958,188
負債純資産合計	432,180,033,832	456,400,571,909

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年9月16日 至 2023年3月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>



## （貸借対照表に関する注記）

項目	（2022年9月15日現在）	（2023年3月15日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	69,478,969,425口	76,032,660,782口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 6.2074円 （1万口当たりの純資産額62,074円）	1口当たり純資産額 6.0004円 （1万口当たりの純資産額60,004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15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15日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	S&P 500 EMINI FUT DEC22	8,790,794,580	-	8,440,959,335	349,835,245
	SPI 200 FUTURES DEC22	389,794,283	-	379,902,155	9,892,128
	FTSE 100 IDX FUT DEC22	482,731,924	-	470,193,851	12,538,073
	EURO STOXX 50 DEC22	1,518,763,876	-	1,481,112,012	37,651,864
	小計	11,182,084,663	-	10,772,167,353	409,917,310
	合計	11,182,084,663	-	10,772,167,353	409,917,310

（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				

市場取引以 外の取引	カナダ・ドル	3,288,630	-	3,263,814	24,816
	デンマーク・クロー ネ	193,870	-	192,269	1,601
	ノルウェー・クロー ネ	142,871	-	142,038	833
	スウェーデン・ク ローナ	270,208	-	267,738	2,470
	小計	3,895,579	-	3,865,859	29,720
	売建				
	アメリカ・ドル	108,314,250	-	107,454,600	859,650
	香港・ドル	5,336,145	-	5,293,602	42,543
	イギリス・ポンド	8,304,700	-	8,261,530	43,170
	イスラエル・シケ ル	419,845	-	418,164	1,681
ユーロ	23,065,280	-	22,872,704	192,576	
小計	145,440,220	-	144,300,600	1,139,620	
合 計	149,335,799	-	148,166,459	1,109,900	

(2023年3月15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 JUN23	6,994,954,146	-	7,106,487,152	111,533,006
	SPI 200 FUTURES MAR23	343,759,625	-	329,931,236	13,828,389
	FTSE 100 IDX FUT JUN23	444,172,556	-	448,979,544	4,806,988
	EURO STOXX 50 JUN23	1,502,881,390	-	1,527,475,594	24,594,204
	小計	9,285,767,717	-	9,412,873,526	127,105,809
	合 計	9,285,767,717	-	9,412,873,526	127,105,809

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(単位：円)

	契 約 額 等	

区分	種類		うち 1年超	時価	評価損益
市場取引以 外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	1,935,215,797	-	1,939,343,826	4,128,029
	カナダ・ドル	102,643,534	-	103,450,208	806,674
	オーストラリア・ド ル	35,979,360	-	35,983,880	4,520
	イギリス・ボンド	145,968,638	-	146,942,977	974,339
	スイス・フラン	75,576,352	-	76,125,768	549,416
	デンマーク・クロー ネ	23,673,368	-	23,670,928	2,440
	スウェーデン・ク ローナ	30,646,458	-	31,269,726	623,268
	ユーロ	369,333,494	-	371,261,285	1,927,791
	小計	2,719,037,001	-	2,728,048,598	9,011,597
	売建				
	スイス・フラン	37,690,956	-	37,689,804	1,152
	小計	37,690,956	-	37,689,804	1,152
合計	2,756,727,957	-	2,765,738,402	9,012,749	

## (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15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	59,387,331,594円
同期中における追加設定元本額	20,540,556,519円
同期中における一部解約元本額	10,448,918,688円
2022年9月15日現在の元本の内訳	
三井住友・D C 外国株式インデックスファンド S	35,129,298,031円
三井住友・D C 年金バランス 30 (債券重点型)	274,801,871円

三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,079,950,596円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	773,841,368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)	45,603,721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	909,080,991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	16,732,708,111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
イオン・バランス戦略ファンド	22,350,293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)	222,642,765円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	255,210,888円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	52,301,404円
三井住友D S・外国株式インデックス年金ファンド	1,290,808,408円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	10,647,894円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	44,311,961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)	318,902,712円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	200,436,109円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	1,199,799,906円
三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド	42,559,456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)	470,984,271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>	3,378,368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>	21,720,183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>	567,143,678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>	728,249,671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>	3,134,971,681円
S M A M・バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	10,511,330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>	52,946,745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>	427,084,701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>	38,301,233円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5 <適格機関投資家専用>	93,355,655円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0 <適格機関投資家専用>	440,464,244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>	301,270,219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>	707,407,828円
S M A M・バランスV A株4 0 T <適格機関投資家限定>	200,225円
三井住友・外国株式インデックスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	198,825,155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>	60,711,309円

SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	7,719,760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	69,478,969,425円

(2023年3月15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	69,478,969,425円
同期中における追加設定元本額	11,218,605,852円
同期中における一部解約元本額	4,664,914,495円
2023年3月15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	37,724,140,995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)	813,861,998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)	51,467,916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	972,862,074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	19,254,521,306円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	138,952,588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	23,954,400円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	140,433,069円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	126,965,007円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	472,133,367円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	255,599,172円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	297,528,986円

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	60,105,589円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	1,909,729,726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)	48,822,378円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	3,083,614円
SMBC・DCインデックスファンド(MSCIコクサイ)	576,595,916円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	318,479,149円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	1,765,929,829円
三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド	56,437,956円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	22,505円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	27,108円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	33,586円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	39,724円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	39,724円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	418,345,573円
バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	4,504,406円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型 < 適格機関投資家限定 >	18,997,417円
SMAM・バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 >	483,887,764円
SMAM・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	678,624,260円
SMAM・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	2,968,447,459円
SMAM・バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 >	9,822,476円
SMAM・バランスファンドVL50 < 適格機関投資家限定 >	47,808,223円
SMAM・バランスファンドVA75 < 適格機関投資家専用 >	401,254,495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 >	35,766,460円
SMAM・インデックス・バランスVA25 < 適格機関投資家専用 >	84,832,561円
SMAM・インデックス・バランスVA50 < 適格機関投資家専用 >	411,687,872円
SMAM・バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 >	285,814,713円
SMAM・バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 >	651,616,409円
SMAM・バランスVA株40T < 適格機関投資家限定 >	195,290円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	187,844,775円
SMAM・グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	56,631,240円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 >	7,051,860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

76,032,660,782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15日現在)	(2023年3月15日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	1,650,407,303	1,532,706,877
金銭信託	17,810,893	16,312,322
コール・ローン	458,895,456	444,932,038
株式	19,175,883,995	23,146,833,452
投資信託受益証券	1,198,512,937	1,441,207,159
投資証券	1,928,973,773	2,103,140,935
派生商品評価勘定	1,980,350	9,703,629
未収入金	101,309	-
未収配当金	49,940,617	52,003,885
差入委託証拠金	384,880,216	501,394,103
流動資産合計	24,867,386,849	29,248,234,400
資産合計	24,867,386,849	29,248,234,400
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	62,673,873	-
未払解約金	63,525,116	28,621,989
その他未払費用	303	209
流動負債合計	126,199,292	28,622,198
負債合計	126,199,292	28,622,198
純資産の部		
元本等		
元本	14,441,656,895	18,375,390,123
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	10,299,530,662	10,844,222,079
元本等合計	24,741,187,557	29,219,612,202
純資産合計	24,741,187,557	29,219,612,202
負債純資産合計	24,867,386,849	29,248,234,400

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年9月16日 至 2023年3月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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。 (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>(1) 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> <p>(2) 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15日現在）	（2023年3月15日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	14,441,656,895口	18,375,390,123口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.7132円 （1万口当たりの純資産額17,132円）	1口当たり純資産額 1.5901円 （1万口当たりの純資産額15,901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15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）

（2022年9月15日現在）



## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MSCI EMGMKT DEC22	2,518,219,338	-	2,455,743,882	62,475,456
	小計	2,518,219,338	-	2,455,743,882	62,475,456
合 計		2,518,219,338	-	2,455,743,882	62,475,456

(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	375,000,012	-	376,781,945	1,781,933
	小計	375,000,012	-	376,781,945	1,781,933
	売建				
	トルコ・リラ	12	-	12	-
	小計	12	-	12	-
合 計		375,000,024	-	376,781,957	1,781,933

(2023年3月15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 JUN23	2,562,939,985	-	2,571,512,586	8,572,601
	小計	2,562,939,985	-	2,571,512,586	8,572,601
合 計		2,562,939,985	-	2,571,512,586	8,572,601

(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	389,000,000	-	390,131,028	1,131,028
	小計	389,000,000	-	390,131,028	1,131,028
合 計		389,000,000	-	390,131,028	1,131,028

## (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15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	9,098,817,572円
同期中における追加設定元本額	7,180,273,933円
同期中における一部解約元本額	1,837,434,610円
2022年9月15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	7,997,187,830円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	2,875,270,430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	95,576,545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)	463,254,241円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	1,346,682,816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	14,441,656,895円
-----	-----------------

(2023年3月15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	14,441,656,895円
同期中における追加設定元本額	4,481,756,242円
同期中における一部解約元本額	548,023,014円
2023年3月15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	9,457,673,512円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	3,084,862,933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DS・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NISA・世界分散ファンド	108,486,535円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	5,714,445円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	881,895,423円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	2,236,408,807円
三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド	18,805,663円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	39,354円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	47,702円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	59,031円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	69,168円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	69,168円
SMA M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	60,596,088円
合 計	18,375,390,123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15日現在)	(2023年3月15日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	4,999,145	2,130,780
コール・ローン	128,802,353	58,118,779
投資証券	9,875,778,500	11,163,469,500
未収入金	-	358,785
未収配当金	106,244,828	143,438,925
前払金	42,000	158,000

差入委託証拠金	2,380,000	2,190,000
流動資産合計	10,118,246,826	11,369,864,769
資産合計	10,118,246,826	11,369,864,769
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	116,400	542,400
未払金	100,230,115	-
未払解約金	2,573,041	9,574,275
その他未払費用	142	75
流動負債合計	102,919,698	10,116,750
負債合計	102,919,698	10,116,750
純資産の部		
元本等		
元本	3,654,656,067	4,527,522,178
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	6,360,671,061	6,832,225,841
元本等合計	10,015,327,128	11,359,748,019
純資産合計	10,015,327,128	11,359,748,019
負債純資産合計	10,118,246,826	11,369,864,769

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2022年9月16日 至 2023年3月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</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15日現在）	（2023年3月15日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	3,654,656,067口	4,527,522,178口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.7404円 （1万口当たりの純資産額27,404円）	1口当たり純資産額 2.5090円 （1万口当たりの純資産額25,090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15日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

（2022年9月15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	-	40,030,000	116,400
	小計	40,146,400	-	40,030,000	116,400
合計		40,146,400	-	40,030,000	116,400

（2023年3月15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	-	35,840,000	542,400
	小計	36,382,400	-	35,840,000	542,400
合計		36,382,400	-	35,840,000	542,400

## (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15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	2,701,982,065円
同期中における追加設定元本額	2,546,214,595円
同期中における一部解約元本額	1,593,540,593円
2022年9月15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	2,150,010,280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	29,390,097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	87,019,162円
日興FWS・Jリートインデックス	309,369,643円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	19,868,902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	3,654,656,067円

(2023年3月15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	3,654,656,067円
同期中における追加設定元本額	1,388,885,094円
同期中における一部解約元本額	516,018,983円

## 2023年3月15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	2,344,064,260円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	16,424,468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	35,467,240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	194,303,319円
日興FWS・Jリートインデックス	449,699,571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	4,527,522,178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15日現在)	(2023年3月15日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	172,770,312	324,286,592
金銭信託	2,086,455	1,403,145
コール・ローン	53,757,255	38,271,943
投資証券	24,904,441,990	25,102,185,014
派生商品評価勘定	1,242	46,000
未収入金	1,167,154	1,741,628
未収配当金	76,422,596	82,985,304
流動資産合計	25,210,647,004	25,550,919,626

資産合計	25,210,647,004	25,550,919,626
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	207,784	283,228
未払解約金	16,968,613	30,909,909
その他未払費用	126	65
流動負債合計	17,176,523	31,193,202
負債合計	17,176,523	31,193,202
純資産の部		
元本等		
元本	8,386,046,114	9,476,339,407
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	16,807,424,367	16,043,387,017
元本等合計	25,193,470,481	25,519,726,424
純資産合計	25,193,470,481	25,519,726,424
負債純資産合計	25,210,647,004	25,550,919,626

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年9月16日 至 2023年3月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>



## （貸借対照表に関する注記）

項目	（2022年9月15日現在）	（2023年3月15日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	8,386,046,114口	9,476,339,407口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.0042円 （1万口当たりの純資産額30,042円）	1口当たり純資産額 2.6930円 （1万口当たりの純資産額26,930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15日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

（2022年9月15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	251,800,000	-	251,596,496	203,504
	カナダ・ドル	7,100,000	-	7,100,704	704
	オーストラリア・ドル	21,100,000	-	21,097,074	2,926
	香港・ドル	5,800,000	-	5,798,983	1,017
	シンガポール・ドル	8,200,000	-	8,200,538	538
	イギリス・ポンド	16,100,000	-	16,099,960	40
	ユーロ	11,800,000	-	11,799,703	297
小計	321,900,000	-	321,693,458	206,542	
合計	321,900,000	-	321,693,458	206,542	

（2023年3月15日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

		契約額等	

区 分	種 類		うち 1年超	時 価	評価損益
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	19,400,000	-	19,446,000	46,000
	小計	19,400,000	-	19,446,000	46,000
	売建				
	アメリカ・ドル	26,400,000	-	26,683,228	283,228
	小計	26,400,000	-	26,683,228	283,228
	合 計	45,800,000	-	46,129,228	237,228

## (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15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	5,796,191,821円
同期中における追加設定元本額	3,433,282,471円
同期中における一部解約元本額	843,428,178円
2022年9月15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	7,136,405,301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	79,892,384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D S・外国リートインデックス年金ファンド	207,764,640円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	69,417,859円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	322,929,986円
三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド	22,192,438円
S M A M・世界リート・インデックスファンドV A <適格機関投資家限定>	37,778,851円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	30,874,063円
S M D A M・リスクコントロール型バランスファンド2 0 2 1 0 5 (リスク3%)	
<適格機関投資家限定>	74,020,828円
合 計	8,386,046,114円

(2023年3月15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	8,386,046,114円
同期中における追加設定元本額	1,473,854,502円
同期中における一部解約元本額	383,561,209円
2023年3月15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・D C外国リートインデックスファンド	7,659,124,442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	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・D CつみたてN I S A・世界分散ファンド	97,033,523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	881,315円
三井住友D S・外国リートインデックス年金ファンド	363,948,313円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	96,879,825円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	460,699,226円
三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド	24,151,135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	7,339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	7,706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	9,541円
三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2 0 5 5	11,376円
三井住友D S・D Cターゲットイヤーファンド2 0 6 5	11,376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>	35,722,574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>	31,468,138円
S M D A M・リスクコントロール型バランスファンド2 0 2 1 0 5 (リスク3%)	
<適格機関投資家限定>	61,703,477円
合 計	9,476,339,407円

国内債券パッシブ・マザーファンド

## ( 1 ) 貸借対照表

( 単位：円 )

	( 2022年9月15日現在 )	( 2023年3月15日現在 )
資産の部		
流動資産		
金銭信託	17,894,818	15,839,296
コール・ローン	461,057,773	432,029,862
国債証券	103,538,045,580	95,619,860,540
地方債証券	10,286,652,700	9,400,696,700
特殊債券	9,472,723,874	9,048,736,475
社債券	6,430,311,900	6,586,965,200
未収入金	299,298,000	172,201,800
未収利息	368,642,924	349,537,586
前払費用	16,642,812	11,981,319
流動資産合計	130,891,270,381	121,637,848,778
資産合計	130,891,270,381	121,637,848,778
負債の部		
流動負債		
未払金	302,060,000	-
未払解約金	9,849,999	90,682,285
その他未払費用	711	658
流動負債合計	311,910,710	90,682,943
負債合計	311,910,710	90,682,943
純資産の部		
元本等		
元本	105,094,252,769	98,364,946,686
剰余金		
剰余金又は欠損金 ( )	25,485,106,902	23,182,219,149
元本等合計	130,579,359,671	121,547,165,835
純資産合計	130,579,359,671	121,547,165,835
負債純資産合計	130,891,270,381	121,637,848,778

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2022年9月16日 至 2023年3月15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>

	(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。
--	---

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年9月15日現在)	(2023年3月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	105,094,252,769口	98,364,946,686口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2425円 (1万口当たりの純資産額12,425円)	1口当たり純資産額 1.2357円 (1万口当たりの純資産額12,357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15日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

(2022年9月15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	107,296,279,211円
同期中における追加設定元本額	23,725,965,224円
同期中における一部解約元本額	25,927,991,666円
2022年9月15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）	7,406,697,874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）	2,847,369,109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）	824,032,455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）	504,237,561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）	881,912,608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）	451,171,893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）	581,608,933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	58,773,995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)	655,230,772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	198,023,292円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	284,295,813円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	506,406,377円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	146,630,256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>	1,216,302,744円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	11,444,903,991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)	1,110,028,448円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	411,827,535円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	501,218,442円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	171,990,647円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	43,709,085円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,353,212,908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>	649,175,832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>	4,983,463,845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>	1,216,079,460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	105,094,252,769円

(2023年3月15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	105,094,252,769円
同期中における追加設定元本額	10,140,979,469円
同期中における一部解約元本額	16,870,285,552円

## 2023年3月15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)	8,060,156,621円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	12,931,466,984円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,070,418,190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)	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)	551,644,169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)	955,791,371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)	639,183,236円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	139,895,204円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	984,157,602円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	334,157,236円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	13,049,588円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	69,807,561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)	752,427,399円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	1,145,605,715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N I S A・世界分散ファンド	226,846,522円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	319,228,609円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	626,452,038円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	184,629,814円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	8,974,314円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	363,085円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	298,337円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	201,623円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	109,828円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	109,828円
S M A M・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,162,297,813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>	9,991,382,262円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用>	5,855,189,273円
S M A M・バランスファンドV A 5 0<適格機関投資家専用>	14,831,160,710円
S M A M・バランスファンドV L 3 0<適格機関投資家限定>	299,804,746円
S M A M・バランスファンドV L 5 0<適格機関投資家限定>	474,854,090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>	248,499,049円
S M A M・バランスファンドV L 国際分散型<適格機関投資家限定>	120,221,118円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5<適格機関投資家専用>	1,728,657,415円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0<適格機関投資家専用>	2,036,392,293円
S M A M・バランスファンドV A 4 0<適格機関投資家専用>	2,141,556,909円

SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	7,661,087,808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)	1,060,066,451円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	379,055,944円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	475,881,321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>	204,865,104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>	4,720,796,820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	98,364,946,686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15日現在)	(2023年3月15日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	216,564,438	161,591,977
金銭信託	18,064,600	15,177,450
コール・ローン	465,432,190	413,977,460
国債証券	155,890,377,628	152,139,434,551
未収入金	190,000,000	-
未収利息	920,933,624	984,831,721
前払費用	58,682,007	90,512,457
流動資産合計	157,760,054,487	153,805,525,616
資産合計	157,760,054,487	153,805,525,616
負債の部		
流動負債		
未払解約金	127,693,366	42,823,658
その他未払費用	2,226	1,128
流動負債合計	127,695,592	42,824,786
負債合計	127,695,592	42,824,786
純資産の部		
元本等		
元本	76,838,969,286	78,493,121,184



剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	80,793,389,609	75,269,579,646
元本等合計	157,632,358,895	153,762,700,830
純資産合計	157,632,358,895	153,762,700,830
負債純資産合計	157,760,054,487	153,805,525,616

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年9月16日 至 2023年3月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年9月15日現在)	(2023年3月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	76,838,969,286口	78,493,121,184口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.0515円 (1万口当たりの純資産額20,515円)	1口当たり純資産額 1.9589円 (1万口当たりの純資産額19,589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15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。

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

(2022年9月15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	81,268,533,582円
同期中における追加設定元本額	11,553,388,274円
同期中における一部解約元本額	15,982,952,570円
2022年9月15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	25,304,482,065円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	827,910,098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)	152,307,236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)	248,203,179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)	23,049,883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
イオン・バランス戦略ファンド	91,907,319円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	21,357,598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	159,295,969円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	577,222,845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)	89,616,419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)	403,500,040円

三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド	15,941,186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>	3,750,777,043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>	6,103,985,887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>	4,100,250,322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>	1,378,765,001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>	4,285,807,535円
S M A M・バランスV A株4 0 T<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 )	314,842,938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>	123,562,590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>	70,414,909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>	83,863,867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>	376,933,887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>	87,683,866円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A 2<適格機関投資家専用>	37,410,392円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A 2<適格機関投資家専用>	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>	925,220,721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	76,838,969,286円

( 2023年3月15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	76,838,969,286円
同期中における追加設定元本額	6,937,658,649円
同期中における一部解約元本額	5,283,506,751円
2023年3月15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	26,183,075,543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・DC年金バランス50(標準型)	2,309,569,115円
三井住友・DC年金バランス70(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・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	6,338,663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)	30,005,779円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	104,058,978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)	273,427,860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)	198,862,879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)	315,911,452円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	23,517,516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)	94,696,284円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	29,892,971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・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	190,484,896円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	758,730,584円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	36,682,943円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	111,796,513円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	77,902,354円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	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)	920,011,306円
三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド	106,067,856円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	27,622円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	32,834円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	40,651円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	47,947円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	47,947円
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>	4,256,856,781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>	30,152,077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>	5,508,730,889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>	3,950,525,621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>	9,244,600,710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>	29,825,111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>	74,453,005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>	637,940,236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>	110,927,414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>	942,176,072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>	1,268,921,919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>	1,323,429,747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>	4,104,174,292円
S M A M・バランスV A株4 0 T<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>	7,072,543,934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)	344,815,405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>	37,643,421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>	890,015,063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>	723,066,850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>	261,078,866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	78,493,121,184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15日現在)	(2023年3月15日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	41,017,587	22,146,011
金銭信託	4,897,342	2,307,698
コール・ローン	126,179,422	62,944,375
国債証券	26,198,092,878	20,774,170,490
派生商品評価勘定	1,458,900	132,084,878
未収入金	193,464,307	-
未収利息	126,217,095	128,323,066
前払費用	31,571,206	14,512,735
流動資産合計	26,722,898,737	21,136,489,253
資産合計	26,722,898,737	21,136,489,253
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	653,700,458	11,022,059
未払金	10,299,069	-
未払解約金	251,000,000	1,000,000
その他未払費用	292	333
流動負債合計	914,999,819	12,022,392
負債合計	914,999,819	12,022,392

純資産の部		
元本等		
元本	19,909,411,282	16,823,671,727
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	5,898,487,636	4,300,795,134
元本等合計	25,807,898,918	21,124,466,861
純資産合計	25,807,898,918	21,124,466,861
負債純資産合計	26,722,898,737	21,136,489,253

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年9月16日 至 2023年3月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年9月15日現在)	(2023年3月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	19,909,411,282口	16,823,671,727口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2963円 (1万口当たりの純資産額12,963円)	1口当たり純資産額 1.2556円 (1万口当たりの純資産額12,556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15日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(2022年9月15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					
	カナダ・ドル	4,711	-	4,719	8	
	デンマーク・クローネ	19	-	19	-	
	ポーランド・ズロチ	2,429	-	2,428	1	
	小計	7,159	-	7,166	7	
	売建					
	アメリカ・ドル	13,541,672,276	-	13,916,025,974	374,353,698	
	カナダ・ドル	549,580,723	-	564,244,705	14,663,982	
	オーストラリア・ドル	406,456,151	-	413,557,844	7,101,693	
	シンガポール・ドル	255,454,468	-	261,408,764	5,954,296	
	イギリス・ポンド	1,207,208,805	-	1,235,086,481	27,877,676	
	イスラエル・シケル	102,531,296	-	102,803,154	271,858	
	デンマーク・クローネ	97,047,660	-	99,172,341	2,124,681	
	ノルウェー・クローネ	53,836,115	-	54,725,150	889,035	
	スウェーデン・クローナ	66,863,394	-	68,607,594	1,744,200	
	メキシコ・ペソ	213,210,399	-	222,138,792	8,928,393	
	オフショア・人民元	750,597,731	-	764,605,347	14,007,616	
	ポーランド・ズロチ	113,293,435	-	116,390,464	3,097,029	
	ユーロ	8,773,243,956	-	8,964,471,364	191,227,408	
	小計	26,130,996,409	-	26,783,237,974	652,241,565	
	合 計		26,131,003,568	-	26,783,245,140	652,241,558

(2023年3月15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	49,546,614	-	49,656,368	109,754
	カナダ・ドル	4,895,555	-	4,903,500	7,945
	オーストラリア・ド ル	4,500,061	-	4,487,680	12,381
	シンガポール・ドル	3,987,944	-	3,991,380	3,436
	ニュージーランド・ ドル	842,747	-	836,155	6,592
	イギリス・ポンド	4,888,413	-	4,897,308	8,895
	デンマーク・クロー ネ	387,116	-	387,564	448
	メキシコ・ペソ	73,786	-	71,853	1,933
	ユーロ	63,351,398	-	63,482,804	131,406
	小計	132,473,634	-	132,714,612	240,978
	売建				
	アメリカ・ドル	10,370,020,458	-	10,265,898,677	104,121,781
	カナダ・ドル	429,067,774	-	422,552,606	6,515,168
	オーストラリア・ド ル	336,863,881	-	330,473,206	6,390,675
	シンガポール・ドル	210,826,028	-	208,777,001	2,049,027
	ニュージーランド・ ドル	44,516,126	-	44,316,215	199,911
	イギリス・ポンド	980,741,151	-	975,005,205	5,735,946
	イスラエル・シュケ ル	66,865,096	-	66,800,520	64,576
	デンマーク・クロー ネ	66,989,281	-	67,048,572	59,291
	ノルウェー・クロー ネ	42,920,453	-	41,630,043	1,290,410
	スウェーデン・ク ローナ	42,842,176	-	42,291,305	550,871
	メキシコ・ペソ	181,712,226	-	177,620,616	4,091,610
	オフショア・人民元	986,045,316	-	985,423,248	622,068
	ポーランド・ズロチ	93,881,593	-	94,175,620	294,027
	ユーロ	6,931,930,424	-	6,942,387,308	10,456,884
	小計	20,785,221,983	-	20,664,400,142	120,821,841
	合 計	20,917,695,617	-	20,797,114,754	121,062,819

(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15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	17,363,959,464円
同期中における追加設定元本額	10,722,198,759円
同期中における一部解約元本額	8,176,746,941円
2022年9月15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	844,366,483円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	2,468,879,015円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	934,024,678円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	1,711,684,274円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	418,843,195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	61,449,209円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)	514,009,556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	19,909,411,282円

(2023年3月15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	19,909,411,282円
同期中における追加設定元本額	2,460,084,153円
同期中における一部解約元本額	5,545,823,708円

## 2023年3月15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	667,179,226円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	2,852,016,127円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,093,830,007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	71,691,695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	16,823,671,727円

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## 三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）

2023年3月31日現在

資産総額	8,947,810,606円
負債総額	20,651,985円
純資産総額（ - ）	8,927,158,621円
発行済口数	8,852,064,257口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	1.0085円 (10,085円)

## 三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）

2023年3月31日現在

資産総額	4,494,650,170円
負債総額	5,496,507円
純資産総額（ - ）	4,489,153,663円
発行済口数	4,031,235,806口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	1.1136円 (11,136円)

## 三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）

2023年3月31日現在

資産総額	11,939,223,912円
負債総額	13,913,258円
純資産総額（ - ）	11,925,310,654円
発行済口数	9,706,694,822口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	1.2286円 (12,286円)

## 三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）

2023年3月31日現在

資産総額	5,390,971,427円
負債総額	5,105,851円
純資産総額（ - ）	5,385,865,576円
発行済口数	4,078,829,356口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	1.3204円 (13,204円)

## 三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）

2023年3月31日現在

資産総額	5,349,412,337円
負債総額	5,875,124円
純資産総額（ - ）	5,343,537,213円
発行済口数	3,836,437,501口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	1.3928円 (13,928円)

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

## イ 名義書換

該当事項はありません。

## ロ 受益者名簿

作成しません。

## ハ 受益者に対する特典

ありません。

## ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等

## (イ) 受益権の譲渡

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

## (ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

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

## ホ 受益権の再分割

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

## ヘ 償還金

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

## ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### イ 資本金の額および株式数

	2023年3月31日現在
資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060株

###### ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

##### 八 会社の機構

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

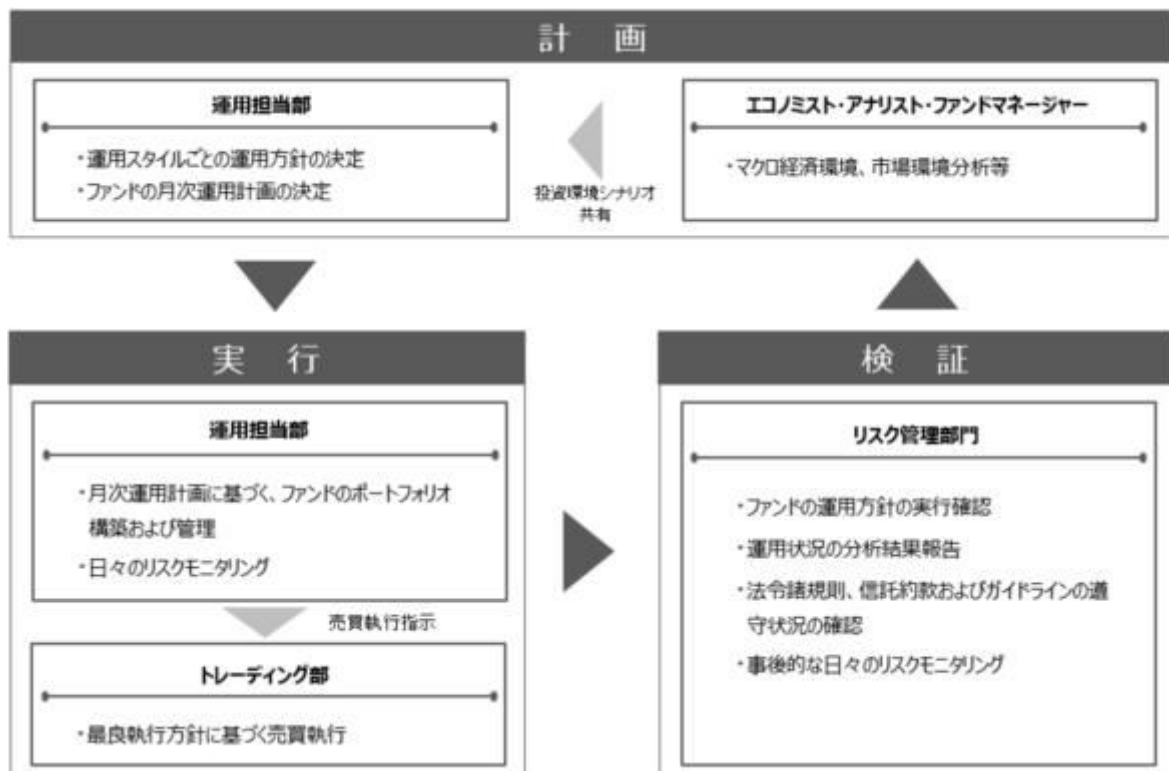
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

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

##### 二 投資信託の運用の流れ



##### 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2023年3月31日現在、委託会社が運用を行っている投資信託(親投資信託は除きます)は、以下の通りです。

	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	704	9,454,549
単位型株式投資信託	96	567,793
追加型公社債投資信託	1	23,746
単位型公社債投資信託	172	279,956
合計	973	10,326,045

### 3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

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

#### (1)【貸借対照表】

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

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

(単位：千円)

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



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

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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

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

## （ 3 ）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：千円）

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

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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：千円）

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

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

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

## [注記事項]

## (重要な会計方針)

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社株式

移動平均法による原価法

## (2) その他有価証券

市場価格のない株式等以外

決算日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産（リース資産を除く）

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

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 4～15年

## (2) 無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

のれん 14年

顧客関連資産 6～19年

ソフトウェア（自社利用分） 5年（社内における利用可能期間）

## (3) リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

### 3. 引当金の計上基準

#### (1) 貸倒引当金

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

#### (2) 賞与引当金

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

#### (3) 退職給付引当金

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

##### 退職給付見込額の期間帰属方法

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

##### 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

### 4. 収益及び費用の計上基準

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

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

#### (1) 委託者報酬

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

#### (2) 運用受託報酬

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

#### (3) 投資助言報酬

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

#### (会計方針の変更)

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

#### (貸借対照表関係)

##### 1 有形固定資産の減価償却累計額

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

##### 2 当座借越契約

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

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

## 3 保証債務

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

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

## (損益計算書関係)

## 1 固定資産除却損

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

## 2 減損損失

前事業年度において、次のとおり減損損失を計上しております。

(単位：千円)

場所	用途	種類	減損損失
-	その他	のれん	28,097,346

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

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

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

## 3 システム統合関連費用

社内システム統合に伴うものであり、主にデータの移行費用などであります。

## 4 早期退職費用

早期希望退職の募集等の実施に関連して発生する費用であります。

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

## 1. 発行済株式数に関する事項

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

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## 配当金支払額等

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

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

## 1. 発行済株式数に関する事項

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数

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

## 2. 剰余金の配当に関する事項

基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの

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

## (リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

(借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

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

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 信用リスクの管理

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

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

## 市場リスクの管理

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度(2021年3月31日)

(単位：千円)

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

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

当事業年度（2022年3月31日）

（単位：千円）

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

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

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

(6)投資有価証券

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

負 債

(1)顧客からの預り金及び(2)未払手数料

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

（注2）市場価格のない金融商品の貸借対照表計上額

（単位：千円）

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

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

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

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

（注3）金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2021年3月31日）

（単位：千円）

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



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

当事業年度（2022年3月31日）

（単位：千円）

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

(有価証券関係)

## 1. 子会社株式

前事業年度（2021年3月31日）

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

当事業年度（2022年3月31日）

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

## 2. その他有価証券

前事業年度（2021年3月31日）

（単位：千円）

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

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

当事業年度（2022年3月31日）

（単位：千円）

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

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

## 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

（単位：千円）

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

（単位：千円）

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

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(単位：千円)

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

(単位：千円)

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

#### 4. 減損処理を行った有価証券

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

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

当事業年度において、減損処理を行った有価証券はありません。

(退職給付関係)

#### 1. 採用している退職給付制度の概要

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

#### 2. 確定給付制度

##### (1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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

##### (3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位：千円)

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

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

#### (4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表わしております。）

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

## 3. 確定拠出制度

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

## (収益認識関係)

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

## (セグメント情報等)

前事業年度(自2020年4月1日至2021年3月31日)

## 1. セグメント情報

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

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

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

## 2. 関連情報

### (1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

### (2) 地域ごとの情報

#### 営業収益

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

#### 有形固定資産

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

### (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

## 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

## 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 2021年4月1日 至2022年3月31日)

### 1. セグメント情報

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

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

## 2. 関連情報

### (1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

### (2) 地域ごとの情報

#### 営業収益

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

#### 有形固定資産

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

### (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

## 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

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

## (関連当事者情報)

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (1)兄弟会社等

(単位：千円)

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

## 2. 親会社に関する注記

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

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (1)兄弟会社等

(単位：千円)

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

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

## 2. 親会社に関する注記

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

## (1株当たり情報)

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

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

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

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

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

## 中間財務諸表

## (1)中間貸借対照表

(単位：千円)

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

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

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

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

## (3)中間株主資本等変動計算書

第38期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

（単位：千円）

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

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

## 注記事項

(重要な会計方針)

## 1. 資産の評価基準及び評価方法

## (1)有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法

その他有価証券

市場価格のない株式等以外

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

## (2)金銭の信託

運用目的の金銭の信託

時価法

## 2. 固定資産の減価償却の方法



## (1)有形固定資産（リース資産を除く）

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

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物	8～50年
器具備品	4～15年

## (2)無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

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

## (3)リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

## 3．引当金の計上基準

## (1)貸倒引当金

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

## (2)賞与引当金

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

## (3)退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

## 4．収益及び費用の計上基準

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

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

## (1)委託者報酬

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

## (2)運用受託報酬

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

## (3)投資助言報酬

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

## （会計方針の変更）

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

## （中間貸借対照表関係）

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

## (中間損益計算書関係)

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

## (中間株主資本等変動計算書関係)

第38期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

## 1.発行済株式数に関する事項

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

## 2.剰余金の配当に関する事項

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

## (リース取引関係)

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

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の時価等に関する事項

第38期中間会計期間（2022年9月30日）

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

（単位：千円）

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

（注1）市場価格のない金融商品

（単位：千円）

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

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

## 2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

（単位：千円）

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

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

## (1) 金銭の信託

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

## (2) 投資有価証券 その他有価証券

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

（有価証券関係）

第38期中間会計期間（2022年9月30日）

## 1. 子会社株式

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

## 2. その他有価証券

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

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

#### (デリバティブ取引関係)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

#### (収益認識関係)

第38期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

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

#### (セグメント情報等)

第38期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

##### 1. セグメント情報

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

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

##### 2. 関連情報

###### (1)製品及びサービスごとの情報

(単位:千円)

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

###### (2)地域ごとの情報

###### 営業収益

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

###### 有形固定資産

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

###### (3)主要な顧客ごとの情報

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

##### 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

##### 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

##### 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

#### (1株当たり情報)

第38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
1株当たり純資産額	2,566円76銭
1株当たり中間純利益	35円26銭

なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

#### 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
株式会社三井住友銀行	1,770,996	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

□ 販売会社

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

3【資本関係】

（持株比率5%以上を記載しています。）  
該当ありません。

第3【その他】

1 目論見書の表紙から本文の前までおよび裏表紙の記載について

- (1) 「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨を記載することがあります。
- (2) 委託会社の金融商品取引業者登録番号を記載することがあります。
- (3) 委託会社のホームページのアドレスおよび他のインターネットのアドレス（これらのアドレスをコード化した図形等も含む）を記載することがあります。
- (4) 請求目論見書の入手方法および投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨を記載することがあります。
- (5) 目論見書の使用開始日を記載することがあります。
- (6) 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。
- (7) 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべき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・資産最適化ファンド（1安定重視型）の2021年9月16日から2022年9月15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・資産最適化ファンド（1安定重視型）の2022年9月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

**財務諸表に対する経営者の責任**

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

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

**独立監査人の監査報告書**

2022年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・資産最適化ファンド（2やや安定型）の2021年9月16日から2022年9月15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・資産最適化ファンド（2やや安定型）の2022年9月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

**財務諸表に対する経営者の責任**

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

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

**独立監査人の監査報告書**

2022年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・資産最適化ファンド（3バランス型）の2021年9月16日から2022年9月15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・資産最適化ファンド（3バランス型）の2022年9月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

**財務諸表に対する経営者の責任**

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

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

**独立監査人の監査報告書**

2022年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・資産最適化ファンド（4やや成長型）の2021年9月16日から2022年9月15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・資産最適化ファンド（4やや成長型）の2022年9月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**その他の記載内容**

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

**財務諸表に対する経営者の責任**

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



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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

**独立監査人の監査報告書**

2022年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・資産最適化ファンド（5成長重視型）の2021年9月16日から2022年9月15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・資産最適化ファンド（5成長重視型）の2022年9月15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. XBR 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・資産最適化ファンド（1安定重視型）の2022年9月16日から2023年3月15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・資産最適化ファンド（1安定重視型）の2023年3月15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16日から2023年3月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

**中間財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

**独立監査人の中間監査報告書**

2023年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・資産最適化ファンド（2やや安定型）の2022年9月16日から2023年3月15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・資産最適化ファンド（2やや安定型）の2023年3月15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16日から2023年3月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

**中間財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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



- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

**独立監査人の中間監査報告書**

2023年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・資産最適化ファンド（3バランス型）の2022年9月16日から2023年3月15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・資産最適化ファンド（3バランス型）の2023年3月15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16日から2023年3月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

**中間財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

**独立監査人の中間監査報告書**

2023年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・資産最適化ファンド（4やや成長型）の2022年9月16日から2023年3月15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・資産最適化ファンド（4やや成長型）の2023年3月15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16日から2023年3月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

**中間財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

**独立監査人の中間監査報告書**

2023年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・資産最適化ファンド（5成長重視型）の2022年9月16日から2023年3月15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・資産最適化ファンド（5成長重視型）の2023年3月15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16日から2023年3月15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。