

【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8月28日提出
【発行者名】	三井住友D Sアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 猿田 隆
【本店の所在の場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【事務連絡者氏名】	土屋 裕子
【電話番号】	03-6205-1649
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド 三井住友D S・日経225インデックス・ファンド 三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド 三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド 三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド 三井住友D S・新興国債インデックス・ファンド 三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド 三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド 三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S・日経225インデックス・ファンド 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S・新興国債インデックス・ファンド 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり） 2兆5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

三井住友D S ・ T O P I X インデックス・ファンド

三井住友D S ・ 日経225 インデックス・ファンド

三井住友D S ・ 先進国株式インデックス・ファンド

三井住友D S ・ 新興国株式インデックス・ファンド

三井住友D S ・ 先進国債インデックス・ファンド

三井住友D S ・ 新興国債インデックス・ファンド

三井住友D S ・ 国内リートインデックス・ファンド

三井住友D S ・ 先進国リートインデックス・ファンド

三井住友D S ・ ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）

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

また、各ファンドを以下の略称でいうことがあります。

三井住友D S ・ T O P I X インデックス・ファンド	: T O P I X インデックス
三井住友D S ・ 日経225 インデックス・ファンド	: 225 インデックス
三井住友D S ・ 先進国株式インデックス・ファンド	: 先進国株インデックス
三井住友D S ・ 新興国株式インデックス・ファンド	: 新興国株インデックス
三井住友D S ・ 先進国債インデックス・ファンド	: 先進国債インデックス
三井住友D S ・ 新興国債インデックス・ファンド	: 新興国債インデックス
三井住友D S ・ 国内リートインデックス・ファンド	: リートインデックス
三井住友D S ・ 先進国リートインデックス・ファンド	: Gリートインデックス
三井住友D S ・ ゴールドインデックス・ファンド （為替ヘッジあり）	: ゴールドインデックスヘッジ有

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンド2兆5,000億円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

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

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

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

(5) 【申込手数料】

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

累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は無手数料となります。

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

(6) 【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

(7) 【申込期間】

2023年8月29日から2024年2月26日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。

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

(9) 【払込期日】

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

お支払いください。

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

(1 0) 【払込取扱場所】

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

(1 1) 【振替機関に関する事項】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(1 2) 【その他】

イ 申込証拠金

ありません。

ロ 日本以外の地域における募集

ありません。

ハ スイッチング

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

ニ お申込不可日

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

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

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

ホ クーリング・オフ制度（金融商品取引法第37条の6）の適用

ありません。

ヘ 振替受益権について

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

(参考：投資信託振替制度)

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

ロ 委託会社は、受託会社と合意の上、各ファンド金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。

ハ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

(イ) 当ファンドが該当する商品分類

三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 (収益の源泉)	株式	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
補足分類	インデックス型	目論見書または信託約款において、各種指数の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド

三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	海外	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 (収益の源泉)	株式	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
補足分類	インデックス型	目論見書または信託約款において、各種指数の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド

項目	該当する商品分類	内容
----	----------	----

単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	海外	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 (収益の源泉)	債券	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
補足分類	インデックス型	目論見書または信託約款において、各種指数の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 (収益の源泉)	不動産投信	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
補足分類	インデックス型	目論見書または信託約款において、各種指数の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	海外	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 (収益の源泉)	不動産投信	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
補足分類	インデックス型	目論見書または信託約款において、各種指数の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

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

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

(ロ) 当ファンドが該当する属性区分

三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産(投資信託証券(株式一般))	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載していません。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式であり、ファンドの収益は株式市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産(収益の源泉)は「株式」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	日本	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいいます。
対象インデックス	TOPIX	目論見書または信託約款において、TOPIX(東証株価指数)の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産(投資信託証券(株式一般))	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載していません。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式であり、ファンドの収益は株式市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産(収益の源泉)は「株式」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	日本	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいいます。

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

三井住友D S ・先進国株式インデックス・ファンド

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（株式一般））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式であり、ファンドの収益は株式市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「株式」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル（日本を除く）	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除く世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	その他の指数（MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース））	目論見書または信託約款において、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

三井住友D S ・新興国株式インデックス・ファンド

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、株価指数先物取引）資産配分変更型））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。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および株価指数先物取引であり、ファンドの収益は株式市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「株式」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	エマージング	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

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

三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産(投資信託証券(債券一般))	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載していません。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は債券であり、ファンドの収益は債券市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産(収益の源泉)は「債券」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル(日本を除く)	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除く世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	その他の指数(FITSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース))	目論見書または信託約款において、FITSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド

項目	該当する属性区分	内容
----	----------	----

投資対象資産	その他資産（投資信託証券（債券一般））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載していません。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は債券であり、ファンドの収益は債券市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「債券」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	エマージング	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	その他の指数（JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース））	目論見書または信託約款において、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（不動産投信））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載していません。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は不動産投信であり、ファンドの収益は不動産投信市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「不動産投信」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	日本	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。

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

三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（不動産投信））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載していません。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は不動産投信であり、ファンドの収益は不動産投信市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「不動産投信」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル（日本を除く）	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除く世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	その他の指数（S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース））	目論見書または信託約款において、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）

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

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

商品分類表

三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド

三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド

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

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

三井住友D S ・国内リートインデックス・ファンド

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

三井住友D S ・先進国リートインデックス・ファンド

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

三井住友D S ・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式	年1回	グローバル (日本を除く)			
一般 大型株 中小型株	年2回	日本			日経225
	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	
一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ()	年12回(毎月)	アジア			
	日々	オセアニア			TOPIX
	その他	中南米			
不動産投信	()	アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券 (株式 一般))		中近東(中東)			その他 (MSCIコクサイ・イ ンデックス(配当込 み、円換算ペー ス))
資産複合 ()		エマージング			
資産配分固 定型 資産配分変 更型					

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド

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

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド

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

資産複合 () 資産配分固 定型 資産配分変 更型		中近東(中東) エマージング		その他 (JPモルガン・エ マージング・マー ケット・ボンド・イン デックス・プラス(円 換算ベース))
---	--	-----------------------	--	---

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般	年1回	グローバル (日本を除く)			

大型株 中小型株	年2回	日本			日経225
	年4回	北米			
債券			ファミリーファンド	あり	
一般	年6回(隔月)	欧州			
公債					
社債	年12回(毎月)	アジア			
その他債券 クレジット属 性 ()	日々	オセアニア			TOPIX
	その他	中南米			
不動産投信	()		ファンド・オブ・ ファンズ	なし	
		アフリカ			
その他資産 (投資信託証券 (不動産投信))					その他 (S&P先進国REI T指数(除く日本、 配当込み、円換算 ベース))
		中近東(中東)			
資産複合 ()					
資産配分固 定型					
資産配分変 更型		エマージング			

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

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

その他資産 (投資信託証券 (商品)) 資産複合 () 資産配分固 定型 資産配分変 更型		中近東(中東) エマージング			その他 (LBMA金価格 (円ヘッジ換算ペー ス))
--	--	-------------------------------	--	--	-------------------------------------

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

(2) 【ファンドの沿革】

2021年8月23日 信託契約締結、設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(イ) 委託会社 「三井住友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。

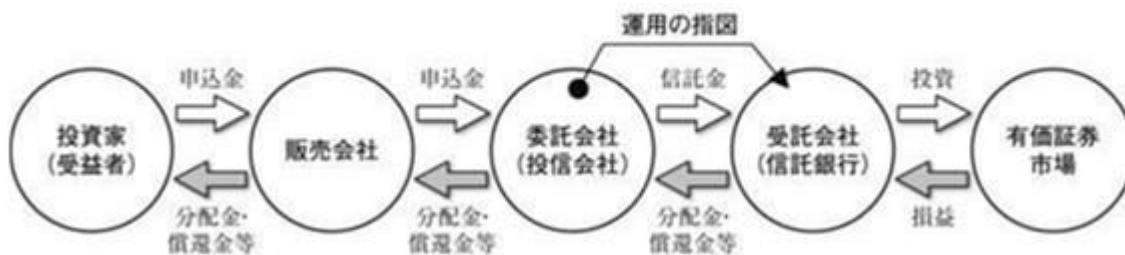
(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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。

運営の仕組み



□ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

20億円（2023年6月30日現在）

(ロ) 会社の沿革

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

(ハ) 大株主の状況

(2023年6月30日現在)

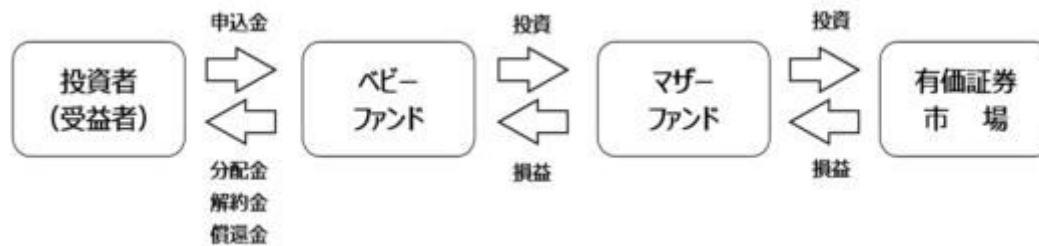
名称	住所	所有株式数 (株)	比率 (%)
株式会社三井住友フィナンシャルグループ	東京都千代田区丸の内一丁目1番2号	16,977,897	50.1
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	7,946,406	23.5
三井住友海上火災保険株式会社	東京都千代田区神田駿河台三丁目9番地	5,080,509	15.0
住友生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区城見一丁目4番35号	3,528,000	10.4
三井住友信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	337,248	1.0

八 ファンドの運用形態

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

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

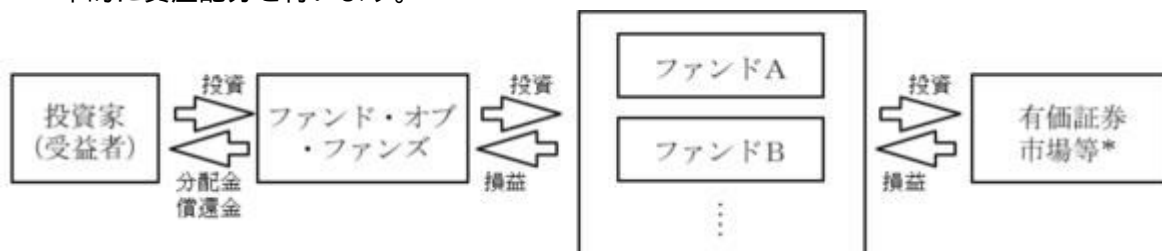
す。



三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）

（ファンド・オブ・ファンズによる運用）

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



*当ファンドにおいては金現物を含みます。

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

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

三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

- （イ）225マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に日本の株式に投資し、日経平均株価（日経225）の動きに連動する投資成果を目指した運用を行います。
- （ロ）225マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。
- （ハ）運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を活用する場合があります。

- (ニ) 株式の実質投資比率は、原則として、純資産総額の+110%以内とします。
- (ホ) 株式以外の資産(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。)への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- (ヘ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

三井住友D S ・先進国株式インデックス・ファンド

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

三井住友D S ・新興国株式インデックス・ファンド

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

三井住友D S ・先進国債インデックス・ファンド

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

三井住友D S ・新興国債インデックス・ファンド

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

三井住友D S ・国内リートインデックス・ファンド

- (イ) Jリート・インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、実質的に以下の運用を行います。

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

三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド

- (イ) 外国リート・インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、実質的に以下の運用を行います。
- ・日本を除く世界各国の不動産投資信託(R E I T)等に投資することにより、S & P先進国R E I T指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
 - ・不動産投資信託(R E I T)等への投資にあたっては、S & P先進国R E I T指数(除く日本)採用銘柄(採用予定を含みます。)に投資を行うものとします。
- (ロ) 外国リート・インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (ニ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

- (イ) ゴールド・インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、主として、金地金価格との連動を目指す投資信託証券に投資し、実質組入外貨建資産について原則として対円での為替ヘッジを行うことにより、ロンドン貴金属市場協会(L B M A)金価格(円ヘッジ換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) ゴールド・インデックス・マザーファンドが主要投資対象とする投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い、商品性及び運用上の効率性を損なわない範囲で、委託会社の判断により見直しを行うことがあります。
- (ハ) ゴールド・インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ニ) 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを活用し、為替変動リスクの低減を図ります。
- (ホ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

ファンドの特色

1

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

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

2

各ファンドは、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。

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

3

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

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

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

ファンドのしくみ

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

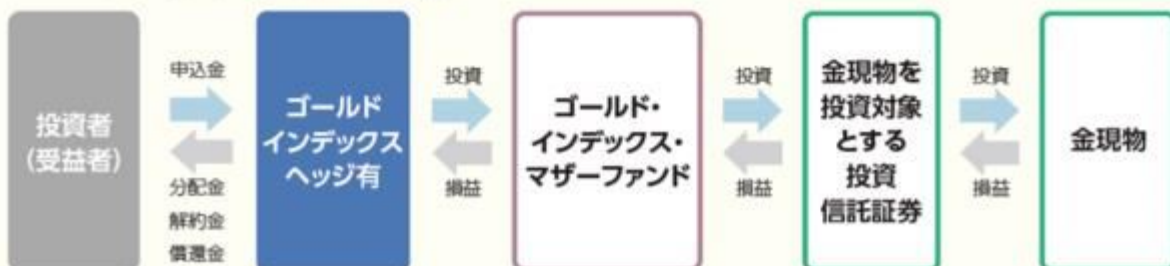
▶各ファンド(ゴールドインデックスヘッジ有を除く)



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

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

▶ゴールドインデックスヘッジ有



各ファンドの運用の基本方針等

▶ 国内株式

TOPIXインデックス

ベンチマーク	TOPIX(東証株価指数、配当込み)
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ● マザーファンドへの投資を通じて、主としてTOPIX(東証株価指数)に採用されている銘柄の株式に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ※株価指数先物取引等を利用することがあります。

225インデックス

ベンチマーク	日経平均株価(日経225)
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ● マザーファンドへの投資を通じて、日本の取引所に上場している株式等に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。

▶ 先進国株式

先進国株インデックス

ベンチマーク	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ● マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を除く世界各国・地域の株式等に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 ※株価指数先物取引等を利用することがあります。 ● 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 ※基準価額は為替変動の影響を受けます。

▶ 新興国株式

新興国株インデックス

ベンチマーク	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ● マザーファンドへの投資を通じて、主として新興国の株式*、新興国の株式指数を対象とした先物取引および新興国の株式等を対象とする上場投資信託証券(ETF)に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。 *預託証券(DR)、株式の値動きに連動する有価証券を含みます。 ※ファンドの資産規模、市況動向に応じて株式、株価指数先物取引、上場投資信託証券(ETF)、短期公社債等および為替取引を組み合わせ運用を行います。 ● 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。 ※基準価額は為替変動の影響を受けます。



預託証券(DR)とは

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

▶ 先進国債券

先進国債インデックス

ベンチマーク FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)

運用の基本方針

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

▶ 新興国債券

新興国債インデックス

ベンチマーク JPMオルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース)

運用の基本方針

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

▶ 国内リート

Jリートインデックス

ベンチマーク 東証REIT指数(配当込み)

運用の基本方針

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

▶ 外国リート

Gリートインデックス

ベンチマーク S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)

運用の基本方針

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

▶ 金

ゴールドインデックスヘッジ有

ベンチマーク LBMA金価格(円ヘッジ換算ベース)

運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、金地金価格との連動を目指す投資信託証券*に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
*マザーファンドが投資対象とする投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い、商品性および運用上の効率性を損なわない範囲で、委託会社の判断により見直しを行うことがあります。
※実質的な投資対象とする投資信託証券は、以下の通りです。
[iShares Gold Trust]
[SPDR Gold MiniShares Trust]
ただし、一部の投資信託証券のみの投資となる場合があります。
- 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。
※完全に為替変動リスクを回避することはできません。

■ ゴールド・インデックス・マザーファンドが投資対象とする投資信託証券の概要

以下は、2023年6月末現在で知り得る情報に基づくものであり、今後、変更される場合があります。

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

*1 管理費用とは各上場投資信託(以下「ETF」といいます。)の運用管理費用およびその他費用を各ETFの平均純資産総額で除したもので、本書の数値は各ETFの直近の目論見書等で開示されているものです。

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

為替の影響について

▶ 為替ヘッジあり

為替ヘッジあり*

為替変動の影響は限定的

*為替ヘッジコストがかかります。

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



為替ヘッジ

為替取引等を利用し、為替変動リスクを低減することです。

▶ 為替ヘッジなし

為替ヘッジなし

円安の場合(為替差益)
基準価額にプラス円高の場合(為替差損)
基準価額にマイナス

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

各ファンドの運用プロセス



*ユニバースの決定を行わないファンドもあります。

[ポートフォリオの構築手法]

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



最適化法とは

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

層化抽出法とは

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

完全法とは

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

※上記の運用プロセスは今後変更される場合があります。

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

追加的記載事項

●各ファンドがベンチマークとする指数の著作権等について

<TOPIXインデックス、Jリートインデックス>

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

<225インデックス>

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

<先進国株インデックス、新興国株インデックス>

MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)およびMSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCI INC.(以下「MSCI」)が公表する指数(MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックス)を基に委託会社が換算したものです。

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

MSCI INDEXは、MSCIの専有財産です。

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

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

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

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

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

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

MSCIは、MSCIが信頼できると考える情報源からMSCI INDEXの算出に使用するための情報を入手するものとしませんが、いずれのMSCI当事者も、MSCI INDEXまたはそのデータの獨創性、正確性、完全性について一切保証しません。

MSCI当事者は、委託会社、受益者、その他の個人もしくは事業体がMSCI INDEXもしくはそのデータを使用して得る情報またはその結果に関して、明示・黙示の保証をしません。

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

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

<先進国債インデックス>

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)は、FTSE Fixed Income LLCが公表する指数(FTSE世界国債インデックス)を基に委託会社が換算したものです。

FTSE世界国債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、FTSE Fixed Income LLCに帰属します。同社は、当ファンドのスポンサーではなく、当ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っていません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、同社は、当該データの正確性および完全性を保証せず、データの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。また、同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。

<新興国債インデックス>

JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース)は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表する指数(JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス)を基に委託会社が換算したものです。

JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスは、信頼できると思われる情報に基づいて作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。委託会社は同インデックスの使用許諾を得て使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承諾なく同インデックスを複製・使用・頒布することは禁じられています。また、J.P. Morgan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。 Copyright © 2021, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

<Gリートインデックス>

S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)は、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが公表する指数(S&P先進国REIT指数)を基に委託会社が換算したものです。

S&P先進国REIT指数は、S&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社(以下「SPDJ」といいます。)の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®は、Standard & Poor's Financial Services LLC(以下「S&P」といいます。)の登録商標で、Dow Jones®は、Dow Jones Trademark Holdings LLC(以下「Dow Jones」といいます。)の登録商標です。指数に直接投資することはできません。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社(総称して「S&P Dow Jones Indices」といいます。)によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは当ファンドの所有者またはいかなる一般人に対して、株式全般または具体的に当ファンドへの投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追跡するS&P先進国REIT指数の能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。指数の過去のパフォーマンスは、将来の成績を示唆または保証するものでもありません。S&P先進国REIT指数に関して、S&P Dow Jones Indicesおよび委託会社との間にある唯一の関係は、同インデックスとS&P Dow Jones Indicesおよび/またはそのライセンサーの特定の商標、サービスマーク、および/または商標名のライセンス供与です。S&P先進国REIT指数は委託会社に関係なく、S&P Dow Jones Indices によって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、S&P先進国REIT指数の決定、構成または計算において委託会社および当ファンドの所有者のニーズを考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの価格および数量、または当ファンドの発行または販売のタイミングの決定、もしくは場合によっては当ファンドが将来換金、譲渡、または償還される計算式の決定または計算に関して、責任を負わず、またこれに関与したこともありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。S&P先進国REIT指数に基づく投資商品が、指数のパフォーマンスを正確に追跡する、またはプラスの投資収益率を提供する保証はありません。S&P Dow Jones Indices LLCは投資または税務の顧問会社ではありません。免税証券のポートフォリオへの影響や特定の投資決断の税効果の評価は、税務顧問会社に相談してください。指数に証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、またはホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。

S&P Dow Jones Indicesは、S&P先進国REIT指数またはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信(電子通信も含まれます。)を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P Dow Jones Indicesは、これに含まれる過誤、遺漏または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、商品性、特定の目的または使用への適合性、もしくはS&P先進国REIT指数を使用することによって、またはそれに関連するデータに関して、委託会社、当ファンドの所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&P Dow Jones Indicesと委託会社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。

<ゴールドインデックスヘッジ有>

LBMA金価格(円ヘッジ換算ベース)は、ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド(ICE Benchmark Administration Limited)が公表する指数(LBMA金価格)を基に委託会社が換算したものです。

LBMA金価格はICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッドが算出し公表している指数であり、同社は、LBM A金価格及びLBMA金価格が示す、あらゆる特定の日、特定の時点における数値により生じた結果について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッドは、当ファンドに関する商品性や特定目的への適合性について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。

(2) 【投資対象】**イ 投資対象とする資産の種類**

- 三井住友D S ・ T O P I X インデックス・ファンド
- 三井住友D S ・ 日経 2 2 5 インデックス・ファンド
- 三井住友D S ・ 先進国株式インデックス・ファンド
- 三井住友D S ・ 新興国株式インデックス・ファンド
- 三井住友D S ・ 先進国債インデックス・ファンド
- 三井住友D S ・ 新興国債インデックス・ファンド
- 三井住友D S ・ 国内リートインデックス・ファンド
- 三井住友D S ・ 先進国リートインデックス・ファンド

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

(口) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1. 為替手形

三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

1. 有価証券

2. 約束手形(金融商品取引法第2条第1項第15号に掲げるものを除きます。)

3. 金銭債権

(ロ) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1. 為替手形

ロ 投資対象とする有価証券

三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド

三井住友D S・日経225インデックス・ファンド

三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド

三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド

三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド

三井住友D S・新興国債インデックス・ファンド

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

1. 株券または新株引受権証書

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)

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

8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)

9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)

10. 資産の流動化に関する法律に規定する特定目的信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第13号で定めるものをいいます。)

11. コマーシャル・ペーパー

12. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券

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

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

15. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。次号において同じ。))で次号に定めるもの以外のもの

16. 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下本号において同じ。))または外国投資証券で投資法人債券に類する証券

17. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)

18. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
 19. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
 20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 21. 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。)
 22. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの
 23. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
- なお、第1号の証券または証書、ならびに第13号、第19号および第21号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第16号の証券ならびに第13号、第19号および第21号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものならびに第19号および第21号の証券または証書のうち第16号の証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第14号および第15号の証券ならびに第19号および第21号の証券または証書のうち第14号および第15号の証券の性質を有するものを以下「投資信託証券」といいます。

三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド

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

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

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

三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド

三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

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

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

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

八 投資対象とする金融商品

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

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

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

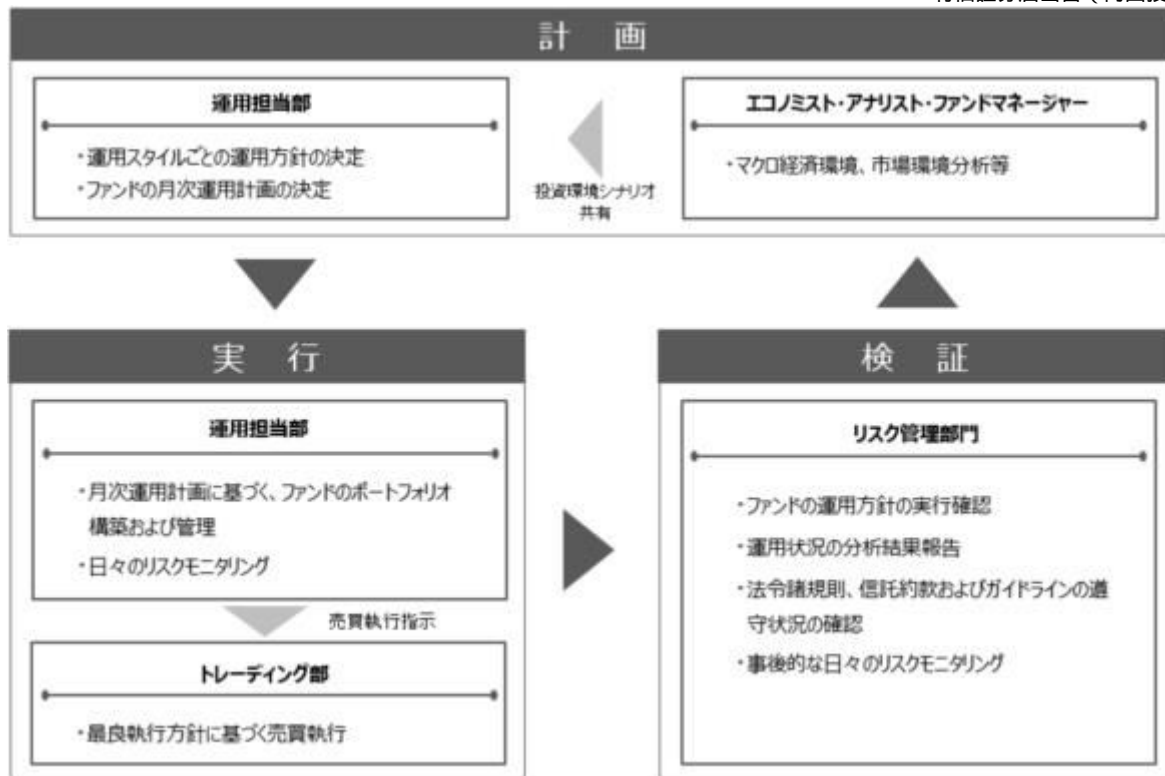
- 三井住友D S ・ 国内リートインデックス・ファンド
- 三井住友D S ・ 先進国リートインデックス・ファンド
- 三井住友D S ・ ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）

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

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

（3）【運用体制】

イ ファンドの運用体制



リスク管理部門の人員数は、約40名です。

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

- ロ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制
ファンドの受託会社に対しては、信託財産の日常の管理業務（保管・管理・計算等）を通じて、信託事務の正確性・迅速性の確認を行い、問題がある場合は適宜改善を求めています。

（４）【分配方針】

年1回（原則として毎年11月30日。休業日の場合は翌営業日となります。）決算を行い、原則として以下の方針に基づき分配金額を決定します。

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

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

（５）【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

- イ 株式への実質投資割合には、制限を設けません。

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

率を合計したものをいいます(以下同じ。)

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

三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

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

三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド

三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド

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

三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

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

三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド

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

合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド

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

三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド

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

三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

- イ 投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。
- ロ 投資信託証券とコマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限りします。
- ハ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- ニ 同一銘柄の投資信託証券への投資割合には、原則として制限を設けません。ただし、当該投資信託証券が一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、当該投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ホ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

三井住友D S・TOPIXインデックス・ファンド

三井住友D S・日経225インデックス・ファンド

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

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

八 信用取引の指図

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

二 先物取引等の指図

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

ホ スワップ取引の指図

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

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

ヘ 金利先渡取引の指図

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

ト 有価証券の貸付けの指図

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

チ 有価証券の空売りの指図

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

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

リ 有価証券の借入れの指図

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

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

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

(二) 上記(イ)の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

ヌ 資金の借入れ

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

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

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

(八) 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。

三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド

三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド

三井住友D S・新興国債インデックス・ファンド

イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

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

ロ 投資する株式等の範囲

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

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

ハ 信用取引の指図

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

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

ニ 先物取引等の指図

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

ホ スワップ取引の指図

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

ヘ 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図

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

行うことの指図をすることができます。

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

ト 有価証券の貸付けの指図

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

の各号の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。

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

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

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

チ 有価証券の空売りの指図

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

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

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

リ 有価証券の借入れの指図

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

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

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

(ニ) 上記(イ)の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

ヌ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ル 外国為替予約取引の指図

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

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

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

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

ロ 資金の借入れ

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

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

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

三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

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

ロ 投資する株式等の範囲

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

ハ 同一発行体の発行する公社債への投資制限

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

ニ 信用取引の指図

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

ホ 先物取引等の指図

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

ヘ スワップ取引の指図

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

ト 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図

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

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

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

チ 有価証券の貸付けの指図

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

リ 有価証券の空売りの指図

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

ヌ 有価証券の借入れの指図

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

ル 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ロ 外国為替予約取引の指図

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

ワ 資金の借入れ

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

3．借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内

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

三井住友D S ・国内リートインデックス・ファンド

イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

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

ロ 公社債の借入れの指図

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

ハ 先物取引等の指図

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

二 資金の借入れ

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

三井住友D S ・先進国リートインデックス・ファンド

イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

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

ロ 公社債の借入れの指図

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

供の指図をするものとします。

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

八 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

二 外国為替予約取引の指図

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

ホ 先物取引等の指図

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

ヘ 資金の借入れ

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

三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）

イ 公社債の借入れの指図

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

(二) 上記(イ)の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

□ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

八 外国為替予約取引の指図

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

二 資金の借入れ

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

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

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

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

(二) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

法令に基づく投資制限

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

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

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

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

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

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

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

(参考情報：マザーファンドの投資方針等)

(国内株式インデックス・マザーファンド(B号))

(1) 投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

1. 株券または新株引受権証書

2. 国債証券

3. 特別の法律により法人の発行する債券

4. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

ハ 投資対象とする金融商品

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

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 外貨建資産への投資は行いません。

(ロ) 株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

る目的以外には利用しません。

（225マザーファンド）

（1）投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

（ロ）株式の組入比率は高位を保ちます。

（ハ）運用の効率化を図るため、日経平均先物取引を利用することもあります。

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

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

（2）投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

1．株券または新株引受権証書

2．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

5．抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

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

なお、第1号の証券または証書を以下「株式」といいます。

ハ 投資対象とする金融商品

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

（3）投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）株式への投資割合には制限を設けません。

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

（外国株式インデックス・マザーファンド）

（1）投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

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

ハ 投資対象とする金融商品

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

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

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

(エマージング株式インデックス・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

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

よび新株予約権証券

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

八 投資対象とする金融商品

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

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

(外国債券パッシブ・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

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

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

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

21. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

八 投資対象とする金融商品

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

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

(米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

J Pモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

- (イ) 主として米ドル建ての新興国の公社債に投資することにより、J Pモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。ただし、運用の効率性を勘案し、流動性の高い国、銘柄を中心に投資します。
- (ロ) 組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (ハ) 公社債の組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ニ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

ハ 投資対象とする金融商品

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

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

(Jリート・インデックス・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

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

ハ 投資対象とする金融商品

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

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

(ロ) 株式への投資は行いません。

(ハ) 外貨建資産への投資は行いません。

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

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

(外国リート・インデックス・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

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

(ハ) 不動産投資信託(REIT)の組入比率は、原則として高位を保ちます。

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

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

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

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

2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

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

6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

八 投資対象とする金融商品

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

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

(ロ) 株式への投資は行いません。

(ハ) 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

(ゴールド・インデックス・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

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

別に定める金地金価格との連動を目指す投資信託証券とは、下記のものとします。

iShares Gold Trust

SPDR Gold MiniShares Trust

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

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

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

ハ 投資対象とする金融商品

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

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

(ロ) 投資信託証券とコマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限ります。

(ハ) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(ニ) 同一銘柄の投資信託証券への投資割合には、原則として制限を設けません。ただし、当該投資信託証券が一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、当該投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

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

3【投資リスク】

イ ファンドのもつリスクの特性

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

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

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

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

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

(イ) 株式市場リスク

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

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

(ホ) 信用リスク

ファンドが投資している有価証券や金融商品に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。

(ヘ) 為替変動リスク

(為替ヘッジなし)

「ゴールドインデックスヘッジ有」以外

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

(為替ヘッジあり)

「ゴールドインデックスヘッジ有」

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

(ト) カントリーリスク

海外に投資を行う場合には、投資先の国の政治・経済・社会状況の不安定化、取引規制や税制の変更等によって投資した資金の回収が困難になることや、その影響により投資する有価証券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。

(チ) 流動性リスク

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

基準価額が下落する要因となります。

□ その他の留意点

（イ）ファンド固有の留意点

a. 対象インデックスの動きと連動しない要因

各ファンドは、特定の指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いますが、以下の要因等により、各対象インデックスの動きに連動しないことがあります。

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

b. 外国税制に関する留意点

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

（ロ）投資信託に関する留意点

- ・ 当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用するため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・一部解約により資金の流出入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。
- ・ ファンドのお申込みに関しては、クーリング・オフ制度の適用はありません。
- ・ ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

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

（ハ）分配金に関する留意事項

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



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

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

八 投資リスクの管理体制

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

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

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

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

コンプライアンス担当部は、法令・諸規則等の遵守状況の確認等を行い、結果をコンプライアンス会議に報告します。

（参考情報）投資リスクの定量的比較

ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移

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

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。

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



■225インデックス（ベンチマーク:日経平均株価(日経225)）



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移

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

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



ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較

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

ファンド:
2018年7月~2023年6月
(2022年7月以前はベンチマークの騰落率)

他の資産クラス:
2018年7月~2023年6月



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



ファンド:
2018年7月~2023年6月
(2022年7月以前はベンチマークの騰落率)

他の資産クラス:
2018年7月~2023年6月



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

【 ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移 】

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

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

年間騰落率:
2018年7月~2023年6月
(2022年7月以前はベンチマークの騰落率)

分配金再投資基準価額:
2021年8月~2023年6月



【 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:
2018年7月~2023年6月
(2022年7月以前はベンチマークの騰落率)

他の資産クラス:
2018年7月~2023年6月



■新興国債インデックス(ベンチマーク:JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース))

年間騰落率:
2018年7月~2023年6月
(2022年7月以前はベンチマークの騰落率)

分配金再投資基準価額:
2021年8月~2023年6月



ファンド:
2018年7月~2023年6月
(2022年7月以前はベンチマークの騰落率)

他の資産クラス:
2018年7月~2023年6月



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移

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

■Jリートインデックス(ベンチマーク:東証REIT指数(配当込み))



ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較

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



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



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

【 ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移 】

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

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



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

【 ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較 】

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



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

各資産クラスの指数

日本株	TOPIX(東証株価指数、配当込み) 株式会社J P X 総研または株式会社J P X 総研の関連会社が算出、公表する指数で、日本の株式を対象としています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、日本を除く世界の主要先進国の株式を対象としています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、新興国の株式を対象としています。
日本国債	NOMURA-BPI(国債) 野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する指数で、国内で発行された公募固定利付国債を対象としています。
先進国債	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース) FTSE Fixed Income LLCにより運営されている指数で、日本を除く世界の主要国の国債を対象としています。
新興国債	JPMORGAN・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財産権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。また、上記各指数の発行者および許諾者は、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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

申込手数料は販売会社によるファンドの募集・販売の取扱い事務等の対価です。

累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は無手数料となります。

申込手数料に関する詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

(2) 【換金(解約)手数料】

解約手数料はありません。

(3) 【信託報酬等】

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

信託報酬の配分は以下の通りです。

< 信託報酬率およびその配分 >

ファンド名	信託報酬率	配分（税抜き）		
		委託会社	販売会社	受託会社
TOPIXインデックス 225インデックス	年0.385% （税抜き0.35%）	年0.165%	年0.165%	年0.02%
先進国株インデックス 新興国株インデックス	年0.473% （税抜き0.43%）	年0.205%	年0.205%	年0.02%
先進国債インデックス	年0.297% （税抜き0.27%）	年0.125%	年0.125%	年0.02%
新興国債インデックス	年0.473% （税抜き0.43%）	年0.205%	年0.205%	年0.02%
Jリートインデックス	年0.385% （税抜き0.35%）	年0.165%	年0.165%	年0.02%
Gリートインデックス	年0.473% （税抜き0.43%）	年0.205%	年0.205%	年0.02%
ゴールドインデックス ヘッジ有	年0.385% （税抜き0.35%）	年0.165%	年0.165%	年0.02%
マザーファンドが投資対象とする投資信託	年0.25%程度*			
実質的な負担	ファンドの純資産総額に対して年0.635%（税抜き0.60%）程度*			
*マザーファンドが投資対象とする投資信託の運用管理費用は、管理費用が最大の投資信託の数値を用いています。なお、管理費用は年度によって異なることや実際の組入状況等により実質的な負担も変動します。また、年間最低報酬額等が定められている場合があるため、純資産総額によっては、上記の料率を上回ることがあります。 上記の料率は、2023年6月末現在で知り得る情報に基づくものであり、今後、変更される場合があります。 投資対象とする投資信託の変更等に伴い、実質的な負担が変更となる場合があります。				

上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。

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

(4) 【その他の手数料等】

- イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、原則として、計算期間を通じて毎日、純資産総額に以下の率を乗じて得た金額が信託財産の費用として計上され、「新興国債インデックス」および「ゴールドインデックスヘッジ有」は各計算期末または信託終了のときに、その他のファンドは毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁す

るものとし、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。

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

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

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

リートを実質的な主要投資対象とするファンドでは、株式と同様に取引所等の市場で売買される多数の銘柄のリートの中から、約款上の選定基準に従って適宜組入銘柄を選定して分散投資を行い、また売却を行いますので、組み入れるリートの銘柄や構成比は流動的となります。

リートの多くは法人形態をとっており、その費用には、運用者等に支払う費用以外に、一般の会社と同じように多種多様なものがあり、また、国・地域によっては、開示する項目の基準が異なります。

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

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

(5)【課税上の取扱い】

イ 個別元本について

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

- (ロ) 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合には、各販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本の算出が行われることがあります。
- (ハ) 受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の（収益分配金の課税について）を参照。）

ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

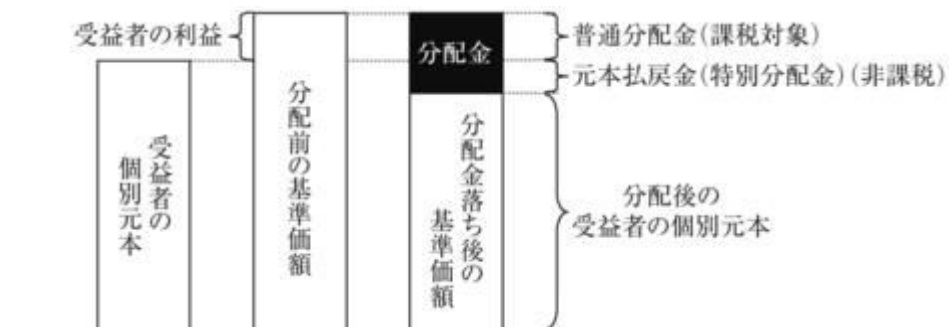
ハ 収益分配金の課税について

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

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



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



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

二 個人、法人別の課税の取扱いについて

(イ) 個人の受益者に対する課税

・収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。確定申告によ

る総合課税または申告分離課税の選択も可能です。

・一部解約時および償還時

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

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

（ロ）法人の受益者に対する課税

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

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

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

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

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

公募株式投資信託は税法上、NISA（少額投資非課税制度）の適用対象であり、2024年1月1日以降は一定の要件を満たした場合に限りNISAの適用対象となります。

※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)

(注) 2024年1月1日以降は、非課税の期間は無期限となり、一定の額を上限として、毎年の利用できる限度額が拡大されます。また、2024年1月1日以降は、税法上の要件を満たした公募株式投資信託等を購入した場合に限り、非課税の適用を受けることができます。
なお、ジュニアNISAで新規の購入ができなくなります。
詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

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6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D S ・ T O P I X インデックス・ファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	169,920,470	100.03
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	49,833	0.03
合計（純資産総額）		169,870,637	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D S ・ 日経 2 2 5 インデックス・ファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	338,389,014	100.03
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	101,909	0.03
合計（純資産総額）		338,287,105	100.00

三井住友D S ・ 先進国株式インデックス・ファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	572,940,498	100.04
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	211,697	0.04
合計（純資産総額）		572,728,801	100.00

三井住友D S ・ 新興国株式インデックス・ファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	106,858,333	100.04
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	39,871	0.04
合計（純資産総額）		106,818,462	100.00

三井住友D S ・ 先進国債インデックス・ファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	313,991,949	100.02

現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	72,805	0.02
合計(純資産総額)		313,919,144	100.00

三井住友D S・新興国債インデックス・ファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	11,049,180	98.39
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	181,206	1.61
合計(純資産総額)		11,230,386	100.00

三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	150,443,712	100.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	46,551	0.03
合計(純資産総額)		150,397,161	100.00

三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	340,123,846	100.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	97,190	0.03
合計(純資産総額)		340,026,656	100.00

三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

2023年6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	732,276,317	102.20
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	15,729,077	2.20
合計(純資産総額)		716,547,240	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	-	43,312,740	6.04
為替予約取引	売建	-	762,159,847	106.37

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

イ 主要投資銘柄

2023年6月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	42,592,989	3.5361	150,614,436	3.9894	169,920,470	100.03

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別投資比率

2023年6月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.03
合計	100.03

三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

イ 主要投資銘柄

2023年6月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	225マザーファンド	75,632,868	3.7461	283,328,609	4.4741	338,389,014	100.03

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別投資比率

2023年6月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.03
合計	100.03

三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド

イ 主要投資銘柄

2023年6月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	80,340,536	6.1677	495,518,658	7.1314	572,940,498	100.04

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2023年6月30日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	100.04
合計	100.04

三井住友D S ・新興国株式インデックス・ファンド

イ 主要投資銘柄

2023年6月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	59,184,898	1.6494	97,621,177	1.8055	106,858,333	100.04

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2023年6月30日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	100.04
合計	100.04

三井住友D S ・先進国債インデックス・ファンド

イ 主要投資銘柄

2023年6月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	148,368,355	1.9675	291,912,524	2.1163	313,991,949	100.02

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2023年6月30日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	100.02
合計	100.02

三井住友D S ・新興国債インデックス・ファンド

イ 主要投資銘柄

2023年6月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信 託受益証 券	米ドル建て新興国 債インデックス・ マザーファンド	11,038,142	0.9186	10,139,785	1.0010	11,049,180	98.39

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6月30日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	98.39
合 計	98.39

三井住友D S ・国内リートインデックス・ファンド

イ 主要投資銘柄

2023年6月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信 託受益証 券	Jリート・イン デックス・マザー ファンド	57,476,108	2.6750	153,746,523	2.6175	150,443,712	100.03

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2023年6月30日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	100.03
合 計	100.03

三井住友D S ・先進国リートインデックス・ファンド

イ 主要投資銘柄

2023年6月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信 託受益証 券	外国リート・イン デックス・マザー ファンド	115,444,928	2.8077	324,133,359	2.9462	340,123,846	100.03

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2023年6月30日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	100.03

合 計	100.03
-----	--------

三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

イ 主要投資銘柄

2023年6月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信 託受益証 券	ゴールド・イン デックス・マザー ファンド	543,030,269	1.2436	675,332,647	1.3485	732,276,317	102.20

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6月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	102.20
合 計	102.20

【投資不動産物件】

三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友D S ・国内リートインデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友D S ・先進国リートインデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友D S ・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

三井住友D S ・T O P I Xインデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友D S ・日経2 2 5インデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友D S ・先進国株式インデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友D S ・新興国株式インデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友D S ・先進国債インデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友D S ・新興国債インデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友D S ・国内リートインデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友D S ・先進国リートインデックス・ファンド

該当事項はありません。

三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）

2023年6月30日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約	アメリカ・ドル	買建	300,000.00	42,366,720	43,312,740	6.04
取引	アメリカ・ドル	売建	5,279,000.00	745,493,694	762,159,847	106.37

（注）日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

三井住友D S・TOPIXインデックス・ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2021年11月30日)	6,046,349	6,046,349	10,294	10,294
第2期 (2022年11月30日)	61,728,569	61,728,569	10,830	10,830
2022年 6月末日	19,836,530	-	10,113	-
7月末日	34,177,319	-	10,483	-
8月末日	44,818,475	-	10,603	-
9月末日	48,813,534	-	10,016	-
10月末日	57,694,445	-	10,524	-
11月末日	61,728,569	-	10,830	-
12月末日	60,547,572	-	10,332	-
2023年 1月末日	79,728,160	-	10,783	-
2月末日	81,815,138	-	10,881	-
3月末日	104,935,888	-	11,061	-
4月末日	121,671,271	-	11,354	-
5月末日	130,501,091	-	11,760	-
6月末日	169,870,637	-	12,642	-

三井住友D S・日経225インデックス・ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2021年11月30日)	69,516,804	69,516,804	10,362	10,362
第2期 (2022年11月30日)	272,425,967	272,425,967	10,597	10,597
2022年 6月末日	95,590,815	-	9,928	-
7月末日	170,027,443	-	10,455	-

8月末日	207,376,259	-	10,566	-
9月末日	210,108,450	-	9,833	-
10月末日	254,004,157	-	10,453	-
11月末日	272,425,967	-	10,597	-
12月末日	257,789,209	-	9,898	-
2023年 1月末日	269,323,406	-	10,361	-
2月末日	269,799,063	-	10,409	-
3月末日	287,815,631	-	10,735	-
4月末日	297,021,102	-	11,045	-
5月末日	298,879,557	-	11,829	-
6月末日	338,287,105	-	12,724	-

三井住友D S ・ 先進国株式インデックス・ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2021年11月30日)	74,584,829	74,584,829	10,652	10,652
第2期 (2022年11月30日)	309,023,748	309,023,748	11,100	11,100
2022年 6月末日	126,561,355	-	10,522	-
7月末日	184,069,131	-	10,929	-
8月末日	242,421,778	-	10,994	-
9月末日	255,478,229	-	10,448	-
10月末日	319,206,849	-	11,442	-
11月末日	309,023,748	-	11,100	-
12月末日	284,543,761	-	10,412	-
2023年 1月末日	324,401,618	-	10,799	-
2月末日	331,799,734	-	11,173	-
3月末日	363,770,293	-	11,111	-
4月末日	452,409,580	-	11,409	-
5月末日	507,297,860	-	11,936	-
6月末日	572,728,801	-	12,870	-

三井住友D S ・ 新興国株式インデックス・ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2021年11月30日)	3,024,503	3,024,503	10,217	10,217
第2期 (2022年11月30日)	22,496,244	22,496,244	9,972	9,972
2022年 6月末日	10,692,756	-	10,366	-
7月末日	12,501,382	-	10,116	-
8月末日	18,792,959	-	10,317	-
9月末日	27,505,993	-	9,533	-
10月末日	27,724,613	-	9,456	-

11月末日	22,496,244	-	9,972	-
12月末日	24,020,869	-	9,567	-
2023年 1月末日	26,133,711	-	10,231	-
2月末日	31,912,428	-	9,922	-
3月末日	31,316,112	-	9,936	-
4月末日	94,122,784	-	9,834	-
5月末日	98,920,896	-	10,249	-
6月末日	106,818,462	-	10,869	-

三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2021年11月30日)	6,787,059	6,787,059	10,037	10,037
第2期 (2022年11月30日)	80,135,860	80,135,860	10,037	10,037
2022年 6月末日	11,764,755	-	10,226	-
7月末日	25,681,595	-	10,286	-
8月末日	32,524,384	-	10,159	-
9月末日	35,150,749	-	10,064	-
10月末日	59,970,450	-	10,349	-
11月末日	80,135,860	-	10,037	-
12月末日	79,902,505	-	9,542	-
2023年 1月末日	84,327,982	-	9,652	-
2月末日	191,756,225	-	9,759	-
3月末日	209,478,882	-	9,878	-
4月末日	281,851,611	-	9,944	-
5月末日	290,938,002	-	10,197	-
6月末日	313,919,144	-	10,599	-

三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2021年11月30日)	1,607,853	1,607,853	9,918	9,918
第2期 (2022年11月30日)	11,569,350	11,569,350	9,187	9,187
2022年 6月末日	6,738,227	-	8,865	-
7月末日	9,260,324	-	9,118	-
8月末日	10,337,423	-	9,293	-
9月末日	10,965,206	-	9,000	-
10月末日	11,387,535	-	9,260	-
11月末日	11,569,350	-	9,187	-
12月末日	12,735,895	-	8,780	-
2023年 1月末日	13,254,529	-	8,840	-

2月末日	9,330,041	-	9,005	-
3月末日	14,448,431	-	9,019	-
4月末日	15,978,577	-	9,150	-
5月末日	10,699,855	-	9,386	-
6月末日	11,230,386	-	9,808	-

三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2021年11月30日)	2,142,283	2,142,283	9,513	9,513
第2期 (2022年11月30日)	118,055,864	118,055,864	9,600	9,600
2022年 6月末日	6,680,661	-	9,485	-
7月末日	27,600,300	-	9,757	-
8月末日	55,184,057	-	9,862	-
9月末日	53,211,128	-	9,453	-
10月末日	78,629,032	-	9,607	-
11月末日	118,055,864	-	9,600	-
12月末日	129,503,608	-	9,259	-
2023年 1月末日	128,023,134	-	8,964	-
2月末日	131,891,486	-	9,102	-
3月末日	130,045,173	-	8,839	-
4月末日	144,748,985	-	9,286	-
5月末日	149,117,185	-	9,343	-
6月末日	150,397,161	-	9,283	-

三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2021年11月30日)	2,304,754	2,304,754	10,763	10,763
第2期 (2022年11月30日)	86,933,845	86,933,845	10,597	10,597
2022年 6月末日	14,800,203	-	10,923	-
7月末日	31,378,532	-	11,486	-
8月末日	62,961,309	-	11,221	-
9月末日	60,685,807	-	9,992	-
10月末日	69,646,483	-	10,862	-
11月末日	86,933,845	-	10,597	-
12月末日	72,935,232	-	9,934	-
2023年 1月末日	80,501,073	-	10,587	-
2月末日	68,062,862	-	10,696	-
3月末日	64,105,282	-	9,958	-
4月末日	122,103,502	-	10,177	-

5月末日	123,970,538	-	10,328	-
6月末日	340,026,656	-	11,061	-

三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2021年11月30日)	37,563,029	37,563,029	9,748	9,748
第2期 (2022年11月30日)	335,482,332	335,482,332	9,277	9,277
2022年 6月末日	98,317,058	-	9,826	-
7月末日	201,552,282	-	9,467	-
8月末日	303,012,975	-	9,277	-
9月末日	317,170,668	-	8,899	-
10月末日	319,678,955	-	8,778	-
11月末日	335,482,332	-	9,277	-
12月末日	370,992,255	-	9,557	-
2023年 1月末日	433,118,317	-	10,039	-
2月末日	450,007,450	-	9,441	-
3月末日	497,083,038	-	10,230	-
4月末日	622,269,346	-	10,217	-
5月末日	678,039,843	-	10,025	-
6月末日	716,547,240	-	9,710	-

【分配の推移】

三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

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

三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

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

三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド

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

三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド

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

三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

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

三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド

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

三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド

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

三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド

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

三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）

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

【収益率の推移】

三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

	収益率（％）
第1期	2.9
第2期	5.2
第3期（中間期）	8.6

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

三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	3.6
第2期	2.3
第3期(中間期)	11.6

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

三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	6.5
第2期	4.2
第3期(中間期)	7.5

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

三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	2.2
第2期	2.4
第3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DS・先進国債インデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	0.4
第2期	0.0
第3期(中間期)	1.6

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

三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	0.8
第2期	7.4
第3期(中間期)	2.2

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

三井住友D S ・国内リートインデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	4.9
第2期	0.9
第3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D S ・先進国リートインデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	7.6
第2期	1.5
第3期(中間期)	2.5

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

三井住友D S ・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

	収益率(%)
第1期	2.5
第2期	4.8
第3期(中間期)	8.1

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

(4) 【設定及び解約の実績】

三井住友D S ・T O P I Xインデックス・ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	11,131,313	5,257,925
第2期	52,125,564	1,000,000
第3期(中間期)	60,376,239	6,402,049

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友D S ・日経225インデックス・ファンド

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

第3期(中間期)	62,027,975	66,442,371
----------	------------	------------

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	72,990,426	2,971,998
第2期	270,552,214	62,163,465
第3期(中間期)	219,098,924	72,484,046

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	2,960,151	0
第2期	29,976,495	10,377,413
第3期(中間期)	80,987,826	7,026,436

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	6,762,046	0
第2期	86,535,230	13,454,513
第3期(中間期)	212,544,035	7,073,704

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友D S・新興国債インデックス・ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	1,621,093	0
第2期	10,979,714	8,229
第3期(中間期)	11,321,436	12,514,302

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	2,350,609	98,727
第2期	132,574,732	11,855,664
第3期(中間期)	42,424,624	5,791,756

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2,141,454	0
第2期	90,161,002	10,267,851
第3期（中間期）	65,043,012	27,039,480

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	38,535,757	0
第2期	379,344,235	56,234,121
第3期（中間期）	403,488,936	88,789,103

（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6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
株式	日本	260,516,878,710	98.35
新株予約権証券	日本	4,583,500	0.00
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	4,368,631,266	1.65
合計（純資産総額）		264,890,093,476	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率 （％）
株価指数先物取引	買建	日本	4,187,040,000	1.58
合計	買建	-	4,187,040,000	1.58

2.2.5 マザーファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
株式	日本	142,007,788,700	96.54
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	5,087,779,009	3.46
合計（純資産総額）		147,095,567,709	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	5,075,010,000	3.45
合計	買建	-	5,075,010,000	3.45

外国株式インデックス・マザーファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	376,923,470,583	67.74
	イギリス	22,147,978,064	3.98
	カナダ	18,836,698,891	3.39
	フランス	17,938,082,119	3.22
	スイス	17,557,801,195	3.16
	ドイツ	13,472,062,864	2.42
	オランダ	10,606,409,850	1.91
	オーストラリア	10,398,561,564	1.87
	アイルランド	10,168,016,479	1.83
	デンマーク	4,777,567,515	0.86
	スウェーデン	4,767,995,486	0.86
	スペイン	4,051,386,542	0.73
	香港	3,003,311,675	0.54
	イタリア	2,899,228,010	0.52
	ジャージー	1,891,424,138	0.34
	シンガポール	1,754,593,165	0.32
	フィンランド	1,748,969,512	0.31
	ベルギー	1,187,824,223	0.21
	ノルウェー	1,001,835,119	0.18
	イスラエル	998,491,512	0.18
	ケイマン諸島	923,601,937	0.17
	バミューダ	750,504,856	0.13
	オランダ領キュ ラソー	696,343,243	0.13
	ニュージーラン ド	446,863,076	0.08
	ルクセンブルグ	300,783,289	0.05
	ポルトガル	286,718,611	0.05
	オーストリア	282,702,958	0.05
	リベリア	237,031,293	0.04
パナマ	173,527,540	0.03	
マン島	95,214,591	0.02	
小計	530,324,999,900	95.31	
投資証券	アメリカ	9,656,921,743	1.74
	オーストラリア	1,031,103,519	0.19
	シンガポール	203,274,071	0.04
	香港	199,563,015	0.04
	イギリス	191,912,967	0.03
	フランス	178,365,792	0.03
	カナダ	59,837,911	0.01
	ベルギー	52,359,397	0.01
	小計	11,573,338,415	2.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	14,548,231,003	2.61
合計(純資産総額)		556,446,569,318	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	629,662,674	0.11
株価指数先物取引	買建	ドイツ	2,181,310,080	0.39
株価指数先物取引	買建	アメリカ	11,190,625,429	2.01
株価指数先物取引	買建	オーストラリア	496,725,470	0.09
合計	買建	-	14,498,323,653	2.61

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	-	1,936,706,089	0.35

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	ケイマン諸島	5,167,755,110	14.89
	台湾	4,769,942,888	13.74
	インド	4,546,448,670	13.10
	韓国	3,821,950,290	11.01
	中国	2,132,772,605	6.14
	ブラジル	1,642,213,495	4.73
	南アフリカ	956,643,991	2.76
	メキシコ	674,981,008	1.94
	インドネシア	622,760,615	1.79
	タイ	586,866,420	1.69
	マレーシア	415,100,099	1.20
	香港	320,575,440	0.92
	ポーランド	241,127,719	0.69
	フィリピン	203,416,358	0.59
	トルコ	172,563,936	0.50
	チリ	167,633,151	0.48
	ギリシャ	140,594,116	0.41
	アメリカ	136,745,088	0.39
	バミューダ	135,862,137	0.39
	ハンガリー	73,901,496	0.21
	チェコ	46,095,099	0.13
	コロンビア	30,584,144	0.09
	ルクセンブルグ	29,395,253	0.08
エジプト	23,754,846	0.07	
オランダ	18,652,116	0.05	
シンガポール	6,996,700	0.02	
ペルー	6,259,702	0.02	
小計		27,091,592,492	78.04
投資信託受益証券	香港	1,518,073,099	4.37
投資証券	アメリカ	2,225,666,215	6.41

	メキシコ	200,997,200	0.58
	ブラジル	68,931,769	0.20
	南アフリカ	8,389,130	0.02
	香港	125,888	0.00
	小計	2,504,110,202	7.21
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	3,600,421,025	10.38
合計（純資産総額）		34,714,196,818	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率 （％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	3,575,231,565	10.30
合計	買建	-	3,575,231,565	10.30

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	-	55,343,744	0.16

外国債券パッシブ・マザーファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
国債証券	アメリカ	80,893,762,278	48.52
	フランス	13,588,630,823	8.15
	イタリア	12,501,359,770	7.50
	ドイツ	10,854,599,136	6.51
	中国	8,889,034,406	5.33
	スペイン	8,429,210,705	5.06
	イギリス	7,926,304,084	4.75
	カナダ	3,390,593,709	2.03
	ベルギー	3,118,811,252	1.87
	オランダ	2,627,127,226	1.58
	オーストラリア	2,513,320,457	1.51
	オーストリア	2,125,773,652	1.27
	メキシコ	1,629,536,527	0.98
	アイルランド	965,305,673	0.58
	マレーシア	858,970,854	0.52
	ポーランド	808,762,575	0.49
	フィンランド	805,176,824	0.48
	シンガポール	733,073,700	0.44
	デンマーク	517,196,338	0.31
	イスラエル	485,217,510	0.29
ニュージーランド	332,633,127	0.20	
スウェーデン	322,096,961	0.19	
ノルウェー	260,265,127	0.16	
	小計	164,576,762,714	98.71
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	2,152,097,490	1.29

合計(純資産総額)	166,728,860,204	100.00
-----------	-----------------	--------

米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	サウジアラビア	397,807,903	9.70
	メキシコ	361,827,329	8.83
	アラブ首長国連邦	333,288,513	8.13
	カタール	328,153,547	8.01
	トルコ	307,156,965	7.49
	ブラジル	290,766,570	7.09
	ドミニカ共和国	254,645,937	6.21
	チリ	245,379,046	5.99
	コロンビア	238,561,036	5.82
	パナマ	217,841,240	5.31
	オマーン	205,782,567	5.02
	ペルー	182,868,347	4.46
	中国	141,120,216	3.44
	インドネシア	136,362,515	3.33
	ウルグアイ	113,587,485	2.77
	南アフリカ	99,652,786	2.43
	ポーランド	86,396,641	2.11
	フィリピン	67,933,904	1.66
	小計	4,009,132,547	97.81
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	89,939,748	2.19
合計(純資産総額)		4,099,072,295	100.00

Jリート・インデックス・マザーファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	日本	12,230,990,700	98.93
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	132,377,012	1.07
合計(純資産総額)		12,363,367,712	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	36,860,000	0.30
合計	買建	-	36,860,000	0.30

外国リート・インデックス・マザーファンド

2023年6月30日現在

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

投資証券			
	アメリカ	22,503,778,857	77.23
	オーストラリア	1,872,012,144	6.42
	イギリス	1,260,765,384	4.33
	シンガポール	1,043,829,491	3.58
	フランス	491,112,891	1.69
	カナダ	482,566,772	1.66
	香港	387,482,777	1.33
	ベルギー	275,847,596	0.95
	ニュージーランド	113,613,377	0.39
	スペイン	109,250,362	0.37
	韓国	66,806,485	0.23
	オランダ	53,248,825	0.18
	イスラエル	35,885,967	0.12
	ガンジー	32,214,132	0.11
	ドイツ	11,791,758	0.04
	アイルランド	9,459,449	0.03
	イタリア	3,002,584	0.01
	小計	28,752,668,851	98.68
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	384,700,686	1.32
合計(純資産総額)		29,137,369,537	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	-	34,545,559	0.12

ゴールド・インデックス・マザーファンド

2023年6月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	アメリカ	5,814,810,625	99.20
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	46,664,194	0.80
合計(純資産総額)		5,861,474,819	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	-	19,564,767	0.33

(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6月30日現在

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

日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	4,370,800	2,004.63	8,761,816,413	2,308.50	10,089,991,800	3.81
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	563,000	11,259.37	6,339,022,767	12,965.00	7,299,295,000	2.76
日本	株式	キーエンス	電気機器	79,600	57,148.67	4,549,033,959	67,850.00	5,400,860,000	2.04
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	4,909,700	761.82	3,740,315,637	1,065.00	5,228,830,500	1.97
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	25,575,000	153.03	3,913,616,142	170.50	4,360,537,500	1.65
日本	株式	三菱商事	卸売業	520,800	4,617.14	2,404,608,896	6,930.00	3,609,144,000	1.36
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	572,900	4,722.35	2,705,434,501	6,159.00	3,528,491,100	1.33
日本	株式	日立製作所	電気機器	390,900	7,300.10	2,853,609,706	8,896.00	3,477,446,400	1.31
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	168,500	15,030.88	2,532,702,741	20,560.00	3,464,360,000	1.31
日本	株式	任天堂	その他製品	502,600	5,884.78	2,957,691,000	6,542.00	3,288,009,200	1.24
日本	株式	三井物産	卸売業	597,500	3,993.61	2,386,179,818	5,411.00	3,233,072,500	1.22
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	706,400	4,061.85	2,869,288,907	4,527.00	3,197,872,800	1.21
日本	株式	第一三共	医薬品	695,400	4,507.39	3,134,440,453	4,550.00	3,164,070,000	1.19
日本	株式	信越化学工業	化学	662,600	3,530.12	2,339,060,165	4,768.00	3,159,276,800	1.19
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	518,600	4,296.70	2,228,271,125	5,687.00	2,949,278,200	1.11
日本	株式	H O Y A	精密機器	170,000	14,066.85	2,391,363,753	17,075.00	2,902,750,000	1.10
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	646,900	3,358.79	2,172,800,987	4,341.00	2,808,192,900	1.06
日本	株式	ダイキン工業	機械	95,900	22,428.36	2,150,879,432	29,265.00	2,806,513,500	1.06
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	605,700	4,320.54	2,616,952,455	4,563.00	2,763,809,100	1.04
日本	株式	K D D I	情報・通信業	617,000	4,111.00	2,536,486,341	4,450.00	2,745,650,000	1.04
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	393,900	5,952.04	2,344,507,286	6,773.00	2,667,884,700	1.01
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	774,700	2,831.26	2,193,376,473	3,315.00	2,568,130,500	0.97
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,134,000	1,731.36	1,963,365,647	2,199.00	2,493,666,000	0.94
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	433,100	3,967.75	1,718,433,583	5,601.00	2,425,793,100	0.92
日本	株式	S M C	機械	26,100	61,857.97	1,614,492,991	79,480.00	2,074,428,000	0.78
日本	株式	村田製作所	電気機器	241,200	7,449.38	1,796,790,414	8,236.00	1,986,523,200	0.75
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,283,200	1,498.02	1,922,265,482	1,540.00	1,976,128,000	0.75
日本	株式	ファナック	電気機器	390,600	4,089.74	1,597,453,964	5,032.00	1,965,499,200	0.74
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	290,300	5,594.06	1,623,955,401	6,205.00	1,801,311,500	0.68
日本	株式	三菱電機	電気機器	830,800	1,385.79	1,151,317,822	2,027.00	1,684,031,600	0.64

□ 種類別・業種別投資比率

2023年6月30日現在

種類	業種	投資比率(%)
----	----	---------

株式（国内）	水産・農林業	0.08
	鉱業	0.29
	建設業	1.98
	食料品	3.33
	繊維製品	0.42
	パルプ・紙	0.16
	化学	5.95
	医薬品	5.10
	石油・石炭製品	0.41
	ゴム製品	0.75
	ガラス・土石製品	0.66
	鉄鋼	0.86
	非鉄金属	0.65
	金属製品	0.51
	機械	5.49
	電気機器	18.01
	輸送用機器	7.83
	精密機器	2.54
	その他製品	2.31
	電気・ガス業	1.25
	陸運業	2.87
	海運業	0.54
	空運業	0.51
	倉庫・運輸関連業	0.14
	情報・通信業	8.11
	卸売業	6.75
	小売業	4.25
	銀行業	6.01
	証券、商品先物取引業	0.69
	保険業	2.25
その他金融業	1.12	
不動産業	1.77	
サービス業	4.76	
新株予約権証券	-	0.00
合計		98.35

2 2 5 マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2023年6月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	435,000	26,884.60	11,694,801,370	36,720.00	15,973,200,000	10.86
日本	株式	東京エレクトロニクス	電気機器	435,000	13,722.52	5,969,297,940	20,560.00	8,943,600,000	6.08

日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	870,000	6,695.73	5,825,283,360	6,773.00	5,892,510,000	4.01
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	290,000	8,323.66	2,413,861,660	19,150.00	5,553,500,000	3.78
日本	株式	ダイキン工業	機械	145,000	21,644.69	3,138,480,200	29,265.00	4,243,425,000	2.88
日本	株式	KDDI	情報・通信業	870,000	4,236.72	3,685,946,280	4,450.00	3,871,500,000	2.63
日本	株式	ファナック	電気機器	725,000	3,983.59	2,888,102,880	5,032.00	3,648,200,000	2.48
日本	株式	信越化学工業	化学	725,000	3,233.55	2,344,323,520	4,768.00	3,456,800,000	2.35
日本	株式	テルモ	精密機器	580,000	4,217.07	2,445,902,200	4,562.00	2,645,960,000	1.80
日本	株式	TDK	電気機器	435,000	4,788.15	2,082,844,170	5,567.00	2,421,645,000	1.65
日本	株式	京セラ	電気機器	290,000	6,745.64	1,956,234,560	7,791.00	2,259,390,000	1.54
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	435,000	4,440.62	1,931,671,350	4,563.00	1,984,905,000	1.35
日本	株式	第一三共	医薬品	435,000	4,568.87	1,987,458,810	4,550.00	1,979,250,000	1.35
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	145,000	10,986.78	1,593,083,010	12,965.00	1,879,925,000	1.28
日本	株式	中外製薬	医薬品	435,000	3,364.63	1,463,611,920	4,086.00	1,777,410,000	1.21
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	725,000	1,944.87	1,410,033,550	2,308.50	1,673,662,500	1.14
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	725,000	2,058.84	1,492,656,000	2,149.00	1,558,025,000	1.06
日本	株式	日東電工	化学	145,000	8,225.31	1,192,670,670	10,630.00	1,541,350,000	1.05
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・データ	情報・通信業	725,000	1,891.20	1,371,118,400	2,007.00	1,455,075,000	0.99
日本	株式	パンダイナムホールディングス	その他製品	435,000	3,098.78	1,347,968,830	3,321.00	1,444,635,000	0.98
日本	株式	セコム	サービス業	145,000	8,185.17	1,186,849,780	9,739.00	1,412,155,000	0.96
日本	株式	エーザイ	医薬品	145,000	8,495.33	1,231,823,080	9,724.00	1,409,980,000	0.96
日本	株式	デンソー	輸送用機器	145,000	7,198.36	1,043,762,490	9,645.00	1,398,525,000	0.95
日本	株式	オリンパス	精密機器	580,000	2,910.02	1,687,813,560	2,266.00	1,314,280,000	0.89
日本	株式	オムロン	電気機器	145,000	6,740.99	977,444,240	8,768.00	1,271,360,000	0.86
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	290,000	3,275.44	949,876,880	4,341.00	1,258,890,000	0.86
日本	株式	富士フイルムホールディングス	化学	145,000	6,786.98	984,112,150	8,541.00	1,238,445,000	0.84
日本	株式	HOYA	精密機器	72,500	13,531.59	981,040,350	17,075.00	1,237,937,500	0.84
日本	株式	キッコーマン	食料品	145,000	7,745.93	1,123,160,300	8,192.00	1,187,840,000	0.81
日本	株式	SMC	機械	14,500	61,983.06	898,754,352	79,480.00	1,152,460,000	0.78

□ 種類別・業種別投資比率

2023年6月30日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式(国内)	水産・農林業	0.06
	鉱業	0.06
	建設業	1.58
	食料品	3.27
	繊維製品	0.11
	パルプ・紙	0.06
	化学	6.66

医薬品	6.46
石油・石炭製品	0.16
ゴム製品	0.74
ガラス・土石製品	0.76
鉄鋼	0.08
非鉄金属	0.69
金属製品	0.02
機械	5.59
電気機器	24.23
輸送用機器	4.40
精密機器	3.80
その他製品	2.52
電気・ガス業	0.15
陸運業	1.29
海運業	0.30
空運業	0.34
倉庫・運輸関連業	0.17
情報・通信業	9.98
卸売業	3.05
小売業	12.32
銀行業	0.57
証券、商品先物取引業	0.21
保険業	0.84
その他金融業	0.72
不動産業	0.97
サービス業	4.35
合計	96.54

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6月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,124,228	20,648.91	23,214,078,009	27,488.65	30,903,514,621	5.55
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	502,199	35,320.46	17,737,898,444	48,578.90	24,396,274,750	4.38
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	655,636	13,636.74	8,940,737,596	18,544.22	12,158,258,879	2.18

アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	175,628	23,871.58	4,192,518,006	59,187.82	10,395,038,064	1.87
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	202,736	26,602.45	5,393,274,908	37,334.93	7,569,133,354	1.36
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CLASS A	メディア・娯楽	422,973	13,967.58	5,907,907,606	17,268.31	7,304,028,462	1.31
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CLASS C	メディア・娯楽	381,442	13,982.04	5,333,336,777	17,400.25	6,637,186,122	1.19
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	157,285	16,628.89	2,615,474,391	40,819.03	6,420,221,872	1.15
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	66,247	76,117.62	5,042,563,975	69,079.04	4,576,278,871	0.82
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CLASS B	金融サービス	92,193	45,698.27	4,213,060,668	48,848.58	4,503,497,218	0.81
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	288,813	16,019.64	4,626,681,304	15,470.43	4,468,062,166	0.80
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	183,997	25,408.88	4,675,156,879	23,792.86	4,377,814,677	0.79
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	208,971	19,829.48	4,143,786,218	20,795.92	4,345,743,299	0.78
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	115,878	30,529.78	3,537,730,078	33,974.06	3,936,845,753	0.71
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	57,598	52,732.72	3,037,299,045	67,346.41	3,879,018,240	0.70
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	29,608	77,284.46	2,288,238,426	125,064.02	3,702,895,631	0.67
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	166,674	21,100.36	3,516,881,814	21,658.61	3,609,926,529	0.65
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	60,378	50,068.45	3,023,033,019	56,208.27	3,393,743,125	0.61
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	195,979	17,926.84	3,513,283,767	17,234.43	3,377,587,297	0.61
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	72,051	45,842.33	3,302,985,715	44,630.82	3,215,695,341	0.58

オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	28,733	88,961.53	2,556,131,756	105,339.84	3,026,729,622	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	181,191	15,767.78	2,856,980,283	16,462.16	2,982,796,066	0.54
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	127,823	26,124.16	3,339,268,211	22,653.24	2,895,604,789	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	117,982	18,819.10	2,220,315,116	22,573.49	2,663,265,261	0.48
フランス	株式	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	耐久消費財・アパレル	19,497	112,081.26	2,185,248,344	134,748.00	2,627,181,756	0.47
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	98,401	26,447.69	2,602,478,996	26,660.76	2,623,445,562	0.47
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	293,671	9,039.28	2,654,574,950	8,702.30	2,555,613,084	0.46
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	31,708	76,505.19	2,425,826,666	77,089.73	2,444,361,257	0.44
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	125,109	22,841.63	2,857,694,076	19,317.02	2,416,732,767	0.43
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	104,999	22,116.37	2,322,196,963	22,369.06	2,348,728,636	0.42

□ 種別・業種別投資比率

2023年6月30日現在

種類	業種	投資比率（%）
株式（外国）	エネルギー	4.69
	素材	3.99
	資本財	6.59
	商業・専門サービス	1.58
	運輸	1.77
	自動車・自動車部品	2.24
	耐久消費財・アパレル	1.67
	消費者サービス	2.10
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.31

	生活必需品流通・小売り	1.70
	食品・飲料・タバコ	3.89
	家庭用品・パーソナル用品	1.68
	ヘルスケア機器・サービス	4.51
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.18
	銀行	5.16
	金融サービス	6.32
	保険	2.98
	ソフトウェア・サービス	9.26
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.93
	半導体・半導体製造装置	5.87
	電気通信サービス	1.20
	公益事業	2.81
	メディア・娯楽	5.61
	不動産管理・開発	0.28
投資証券	-	2.08
合計		97.39

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6月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	793,000	2,288.37	1,814,680,582	2,670.98	2,118,088,884	6.10
香港	投資信託受益証券	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	-	1,930,200	793.7643	1,532,123,782	786.4849	1,518,073,099	4.37
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	-	218,122	5,645.98	1,231,513,346	5,963.44	1,300,757,176	3.75
ケイマン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	200,300	5,181.10	1,037,774,182	6,171.60	1,236,171,480	3.56
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	153,740	6,709.94	1,031,586,051	7,964.00	1,224,385,360	3.53
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	532,500	1,472.91	784,325,422	1,520.70	809,772,750	2.33
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	98,225	4,751.33	466,698,995	4,502.51	442,259,044	1.27
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI UAE ETF	-	186,758	2,219.30	414,471,300	2,138.60	399,401,125	1.15

ケイマン諸島	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	163,360	2,814.01	459,696,963	2,306.95	376,863,352	1.09
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	3,102,000	87.63	271,823,070	93.43	289,804,350	0.83
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	166,904	1,666.75	278,188,002	1,668.66	278,506,195	0.80
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	金融サービス	56,273	4,738.51	266,650,182	4,946.62	278,361,147	0.80
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI QATAR ETF	-	103,513	2,921.83	302,447,768	2,579.37	266,998,544	0.77
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI KUWAIT ETF	-	55,371	5,070.15	280,739,268	4,668.68	258,509,369	0.74
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	106,790	2,875.89	307,116,076	2,302.16	245,847,986	0.71
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	17,554	9,349.61	164,122,979	12,782.00	224,375,228	0.65
ブラジル	株式	VALE SA	素材	110,288	2,526.90	278,686,355	1,954.44	215,551,106	0.62
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	400,800	467.21	187,255,830	526.74	211,116,670	0.61
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	205,000	889.65	182,378,983	924.08	189,435,375	0.55
ケイマン諸島	株式	JD.COM INC-CLASS A	一般消費財・サービス流通・小売り	75,985	3,687.91	280,226,063	2,458.65	186,820,520	0.54
ケイマン諸島	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・娯楽	73,200	1,920.64	140,590,573	2,490.10	182,275,320	0.53
ケイマン諸島	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	63,900	2,064.15	131,899,447	2,823.10	180,396,090	0.52
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	26,456	6,050.99	160,085,083	6,655.00	176,064,680	0.51
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	29,410	6,042.60	177,712,920	5,723.50	168,328,164	0.48
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	16,379	11,549.23	189,164,777	9,989.81	163,623,114	0.47
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER B	電気通信サービス	1,025,500	158.72	162,769,083	159.21	163,265,670	0.47

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	6,368	19,983.08	127,252,234	25,593.96	162,982,347	0.47
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	49,000	3,288.25	161,124,304	3,244.33	158,972,385	0.46
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	1,768,300	87.20	154,187,061	88.76	156,945,466	0.45
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	2,534,000	51.40	130,235,574	57.91	146,731,270	0.42

□ 種類別・業種別投資比率

2023年6月30日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式（外国）	エネルギー	3.99
	素材	5.74
	資本財	3.06
	商業・専門サービス	0.04
	運輸	1.71
	自動車・自動車部品	3.07
	耐久消費財・アパレル	1.20
	消費者サービス	2.35
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.85
	生活必需品流通・小売り	1.38
	食品・飲料・タバコ	2.44
	家庭用品・パーソナル用品	0.74
	ヘルスケア機器・サービス	0.76
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.07
	銀行	10.38
	金融サービス	2.67
	保険	2.31
	ソフトウェア・サービス	1.90
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.85
	半導体・半導体製造装置	8.48
電気通信サービス	2.08	
公益事業	1.99	
メディア・娯楽	5.88	
不動産管理・開発	1.11	
投資信託受益証券	-	4.37
投資証券	-	7.21
合計		89.63

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6月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	11,450,000	13,477.26	1,543,145,751	13,375.76	1,531,524,802	1.625	2026/05/15	0.92
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	8,200,000	13,799.42	1,131,552,706	13,646.02	1,118,973,954	2.250	2026/03/31	0.67
中国	国債 証券	CHINA GOVERNMENT BOND	51,000,000	1,995.51	1,017,708,034	2,013.75	1,027,013,641	2.690	2026/08/12	0.62
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	8,500,000	12,172.35	1,034,649,364	11,905.56	1,011,972,928	1.125	2031/02/15	0.61
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	7,100,000	13,307.33	944,820,230	13,191.48	936,595,092	1.375	2026/08/31	0.56
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	7,200,000	12,504.81	900,346,142	12,386.64	891,838,129	0.625	2027/12/31	0.53
中国	国債 証券	CHINA GOVERNMENT BOND	43,000,000	2,016.96	867,293,999	2,043.19	878,569,807	3.020	2031/05/27	0.53
中国	国債 証券	CHINA GOVERNMENT BOND	38,000,000	2,153.33	818,264,663	2,220.60	843,829,270	3.720	2051/04/12	0.51
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	7,000,000	11,936.74	835,571,570	11,714.61	820,022,842	0.875	2030/11/15	0.49
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	7,000,000	11,747.52	822,326,733	11,536.27	807,539,203	0.625	2030/08/15	0.48
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,600,000	14,036.77	786,059,225	14,023.72	785,328,475	2.375	2024/08/15	0.47
中国	国債 証券	CHINA GOVERNMENT BOND	39,000,000	1,979.24	771,903,474	1,990.64	776,349,706	2.180	2025/08/25	0.47
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,700,000	13,794.35	786,277,870	13,413.46	764,567,212	2.875	2032/05/15	0.46
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,500,000	13,802.32	759,127,767	13,793.77	758,657,275	1.500	2024/10/31	0.46
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	6,000,000	12,789.13	767,347,975	12,607.90	756,473,725	1.375	2028/10/31	0.45
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,300,000	14,451.96	765,953,656	14,232.80	754,338,313	3.875	2026/01/15	0.45
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,900,000	12,565.85	741,385,051	12,433.04	733,549,211	0.750	2028/01/31	0.44
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,300,000	13,887.57	736,041,010	13,622.83	722,009,747	2.750	2028/02/15	0.43
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,000,000	14,825.81	741,290,373	14,391.85	719,592,619	4.000	2028/02/29	0.43
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,100,000	13,984.72	713,220,743	13,922.37	710,041,113	2.250	2024/11/15	0.43
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,200,000	13,584.26	706,381,420	13,632.39	708,884,528	0.750	2024/11/15	0.43
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	4,600,000	15,274.18	702,612,260	14,782.17	679,979,611	4.125	2032/11/15	0.41

ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,100,000	13,413.97	684,112,286	13,313.73	679,000,372	0.000	2030/08/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	12,567.59	691,217,351	12,304.58	676,751,699	1.625	2031/05/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	13,574.11	678,705,439	13,411.58	670,578,750	2.000	2026/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	13,488.56	674,428,234	13,229.18	661,458,879	2.375	2029/03/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	12,683.15	672,206,697	12,391.72	656,760,913	1.875	2032/02/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	13,875.40	666,019,104	13,624.13	653,958,256	2.625	2027/05/31	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,600,000	14,469.20	665,583,409	14,089.98	648,139,227	3.500	2033/02/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,400,000	14,529.16	639,282,948	14,295.87	629,018,236	3.875	2027/12/31	0.38

□ 種類別投資比率

2023年6月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.71
合計	98.71

米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2023年6月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
サウジアラビア	国債証券	SAUDI INTERNATIONAL BOND	1,600,000	12,713.58	203,417,200	11,731.29	187,700,574	2.250	2033/02/02	4.58
ドミニカ共和国	国債証券	DOMINICAN REPUBLIC	1,200,000	13,386.99	160,643,845	13,359.96	160,319,502	6.000	2033/02/22	3.91
アラブ首長国連邦	国債証券	ABU DHABI GOVT INT'L	1,300,000	12,918.10	167,935,247	12,106.67	157,386,645	1.875	2031/09/15	3.84
カタール	国債証券	STATE OF QATAR	1,100,000	14,883.51	163,718,648	14,009.95	154,109,436	3.750	2030/04/16	3.76
オマーン	国債証券	OMAN GOV INTERNTL BOND	1,000,000	14,581.15	145,811,513	14,753.02	147,530,224	6.250	2031/01/25	3.60
カタール	国債証券	STATE OF QATAR	1,100,000	13,778.48	151,563,266	13,256.87	145,825,577	4.400	2050/04/16	3.56
メキシコ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,200,000	12,372.65	148,471,789	12,021.56	144,258,670	2.659	2031/05/24	3.52
ペルー	国債証券	REPUBLIC OF PERU	1,000,000	12,325.16	123,251,649	12,378.96	123,789,562	2.783	2031/01/23	3.02
トルコ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	800,000	14,962.59	119,700,699	14,821.17	118,569,342	9.875	2028/01/15	2.89

メキシコ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	900,000	12,196.62	109,769,609	12,495.82	112,462,363	5.000	2051/04/27	2.74
アラブ首長国連邦	国債証券	ABU DHABI GOVT INT'L	1,000,000	11,352.89	113,528,909	10,656.62	106,566,200	3.125	2049/09/30	2.60
トルコ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	800,000	11,658.28	93,266,267	12,988.06	103,904,473	6.125	2028/10/24	2.53
中国	国債証券	CHINA GOVT INTL BOND	700,000	13,386.99	93,708,921	12,950.22	90,651,517	1.250	2026/10/26	2.21
パナマ	国債証券	REPUBLIC OF PANAMA	800,000	11,488.72	91,909,740	11,050.85	88,406,782	2.252	2032/09/29	2.16
コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	600,000	14,972.63	89,835,804	14,694.16	88,164,939	8.000	2033/04/20	2.15
コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	600,000	14,213.85	85,283,118	14,129.57	84,777,392	7.500	2034/02/02	2.07
パナマ	国債証券	REPUBLIC OF PANAMA	800,000	10,366.62	82,932,975	10,524.10	84,192,793	4.500	2063/01/19	2.05
ブラジル	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	600,000	13,908.84	83,453,054	13,842.05	83,052,301	2.875	2025/06/06	2.03
サウジアラビア	国債証券	SAUDI INTERNATIONAL BOND	600,000	14,536.31	87,217,864	13,785.65	82,713,895	3.625	2028/03/04	2.02
チリ	国債証券	REPUBLIC OF CHILE	600,000	13,269.92	79,619,518	12,823.93	76,943,583	4.340	2042/03/07	1.88
ブラジル	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	600,000	12,619.93	75,719,577	12,491.90	74,951,420	3.750	2031/09/12	1.83
チリ	国債証券	REPUBLIC OF CHILE	600,000	11,565.80	69,394,823	11,859.46	71,156,742	2.550	2033/07/27	1.74
アラブ首長国連邦	国債証券	ABU DHABI GOVT INT'L	500,000	13,992.52	69,962,604	13,867.13	69,335,667	2.500	2025/04/16	1.69
ドミニカ共和国	国債証券	DOMINICAN REPUBLIC	600,000	10,435.73	62,614,366	11,188.01	67,128,050	5.875	2060/01/30	1.64
コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	600,000	11,009.72	66,058,313	10,936.45	65,618,704	3.125	2031/04/15	1.60
ブラジル	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	500,000	13,048.09	65,240,425	12,868.88	64,344,387	3.875	2030/06/12	1.57
ペルー	国債証券	REPUBLIC OF PERU	400,000	15,581.42	62,325,691	14,769.70	59,078,785	5.625	2050/11/18	1.44
インドネシア	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	400,000	13,764.77	55,059,082	14,585.56	58,342,236	5.125	2045/01/15	1.42
オマーン	国債証券	OMAN GOV INTERNTL BOND	400,000	13,768.83	55,075,321	14,563.09	58,252,342	6.000	2029/08/01	1.42
ウルグアイ	国債証券	REPUBLICA ORIENT URUGUAY	400,000	14,554.82	58,219,284	14,306.74	57,226,973	4.375	2031/01/23	1.40

□ 種類別投資比率

2023年6月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	97.81
合計	97.81

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6月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド 投資法人	1,357	571,952.35	776,139,340	566,000.00	768,062,000	6.21
日本	投資証券	ジャパンリアルエ ステイト投資法人	1,192	564,834.99	673,283,303	548,000.00	653,216,000	5.28
日本	投資証券	野村不動産マス ターファンド投資 法人	3,761	151,735.69	570,677,936	166,100.00	624,702,100	5.05
日本	投資証券	日本プロロジス リート投資法人	2,021	294,760.08	595,710,114	289,300.00	584,675,300	4.73
日本	投資証券	日本都市ファンド 投資法人	5,868	100,988.57	592,600,939	96,300.00	565,088,400	4.57
日本	投資証券	G L P 投資法人	3,921	144,716.86	567,434,794	142,100.00	557,174,100	4.51
日本	投資証券	大和ハウスリート 投資法人	1,752	278,319.89	487,616,447	276,200.00	483,902,400	3.91
日本	投資証券	オリックス不動産 投資法人	2,318	181,688.43	421,153,790	177,400.00	411,213,200	3.33
日本	投資証券	アドバンス・レジ デンス投資法人	1,163	334,825.81	389,402,420	344,000.00	400,072,000	3.24
日本	投資証券	ユナイテッド・ アーバン投資法人	2,603	151,086.78	393,278,881	145,400.00	378,476,200	3.06
日本	投資証券	積水ハウス・リー ト投資法人	3,498	72,997.73	255,346,070	83,900.00	293,482,200	2.37
日本	投資証券	インヴィンシブル 投資法人	5,124	55,399.16	283,865,319	57,200.00	293,092,800	2.37
日本	投資証券	日本プライムリア ルティ投資法人	796	358,804.98	285,608,768	348,500.00	277,406,000	2.24
日本	投資証券	ジャパン・ホテ ル・リート投資法 人	3,755	76,835.88	288,518,739	73,500.00	275,992,500	2.23
日本	投資証券	産業ファンド投資 法人	1,776	145,395.85	258,223,030	151,600.00	269,241,600	2.18
日本	投資証券	日本アコモデー ションファンド投 資法人	402	613,883.90	246,781,329	649,000.00	260,898,000	2.11
日本	投資証券	アクティブピア・ブ ロパティーズ投資 法人	612	392,989.58	240,509,625	402,500.00	246,330,000	1.99
日本	投資証券	日本ロジスティク スファンド投資法 人	785	298,649.56	234,439,902	312,500.00	245,312,500	1.98
日本	投資証券	ケネディクス・オ フィス投資法人	675	318,332.67	214,874,549	346,500.00	233,887,500	1.89
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	459	459,866.33	211,078,645	500,000.00	229,500,000	1.86

日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	1,421	156,657.72	222,610,619	151,100.00	214,713,100	1.74
日本	投資証券	イオンリート投資法人	1,337	149,283.03	199,591,412	155,400.00	207,769,800	1.68
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	432	503,125.05	217,350,023	468,000.00	202,176,000	1.64
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	1,369	152,410.32	208,649,734	147,400.00	201,790,600	1.63
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	854	206,879.86	176,675,397	234,300.00	200,092,200	1.62
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	556	315,591.19	175,468,702	345,000.00	191,820,000	1.55
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	1,606	113,492.34	182,268,696	114,400.00	183,726,400	1.49
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	1,090	152,295.99	166,002,627	161,000.00	175,490,000	1.42
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	399	405,188.26	161,670,115	413,000.00	164,787,000	1.33
日本	投資証券	森トラストリート投資法人	2,169	73,095.48	158,544,101	72,000.00	156,168,000	1.26

□ 種類別投資比率

2023年6月30日現在

種類	投資比率（％）
投資証券	98.93
合計	98.93

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6月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価（円）	帳簿価額（円）	評価額単価（円）	評価額（円）	投資比率（％）
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	144,673	17,602.57	2,546,616,356	17,616.29	2,548,600,799	8.75
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	14,648	99,708.69	1,460,532,918	112,661.58	1,650,266,819	5.66
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	24,736	42,498.21	1,051,235,809	41,842.66	1,035,020,139	3.55
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	106,093	9,353.17	992,305,808	8,731.30	926,329,577	3.18
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	78,335	10,895.74	853,517,656	11,655.75	913,052,870	3.13
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	51,267	17,566.59	900,586,141	16,639.05	853,034,299	2.93
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	45,668	15,147.16	691,740,347	16,221.48	740,802,603	2.54
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	157,420	4,807.98	756,871,726	4,549.79	716,227,343	2.46
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	22,330	25,358.75	566,260,844	27,263.92	608,803,324	2.09
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	265,983	1,910.43	508,141,724	1,926.89	512,520,621	1.76

アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	53,125	9,198.15	488,651,761	9,485.25	503,903,683	1.73
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	21,431	23,214.43	497,508,381	21,454.17	459,784,323	1.58
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	91,527	4,572.82	418,536,088	4,948.51	452,922,155	1.55
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	62,544	7,178.16	448,950,886	6,904.42	431,830,282	1.48
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	18,532	23,544.61	436,328,676	22,048.63	408,605,198	1.40
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	24,599	21,649.22	532,549,187	16,437.52	404,346,463	1.39
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	45,585	7,596.51	346,287,023	8,142.64	371,182,171	1.27
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	19,281	21,157.67	407,940,983	18,641.36	359,424,145	1.23
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,055	33,143.57	333,258,624	33,792.82	339,786,798	1.17
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	33,806	11,786.82	398,465,299	9,794.07	331,098,482	1.14
香港	投資証券	LINK REIT	403,700	925.45	373,602,937	807.53	325,997,842	1.12
アメリカ	投資証券	UDR INC	48,632	6,306.15	306,680,773	6,217.17	302,353,469	1.04
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	40,380	7,622.76	307,807,074	7,040.71	284,304,047	0.98
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	96,981	2,983.67	289,358,923	2,856.30	277,007,121	0.95
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	111,435	2,462.55	274,414,404	2,419.88	269,659,673	0.93
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	17,080	16,725.90	285,678,327	15,747.36	268,964,975	0.92
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	27,136	10,020.89	271,926,803	9,624.44	261,168,700	0.90
アメリカ	投資証券	LIFE STORAGE INC	13,356	17,455.80	233,139,605	19,177.83	256,139,061	0.88
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	85,738	3,522.21	301,987,049	2,896.90	248,374,429	0.85
アメリカ	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	48,526	4,578.90	222,195,577	5,115.25	248,222,485	0.85

□ 種類別投資比率

2023年6月30日現在

種類	投資比率（％）
投資証券	98.68
合計	98.68

ゴールド・インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄

2023年6月30日現在

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

アメリカ	投資信託 受益証券	SPDR Gold MiniShares Trust	821,360	5,186.2477	4,259,776,419	5,489.3214	4,508,709,025	76.92
アメリカ	投資信託 受益証券	ISHARES GOLD TRUST	249,190	4,803.3987	1,196,958,927	5,241.3885	1,306,101,600	22.28

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6月30日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.20
合計	99.20

投資不動産物件

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

該当事項はありません。

225マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

Jリート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

外国リート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

ゴールド・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

2023年6月30日現在

種類	国/ 地域	取引所 等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
----	----------	----------	----	-----------	----	----	-----------	-----------	-----------------

株価指数 先物取引	日本	大阪取引 所	TOPI X 先 物 0509 月 2023年 9月	買建	183	日本・円	4,140,446,300	4,187,040,000	1.58
--------------	----	-----------	--	----	-----	------	---------------	---------------	------

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2.2.5 マザーファンド

2023年6月30日現在

種類	国/ 地域	取引所 等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	日本	大阪取引 所	NK22 5 先 物 0509 月 2023年 9月	買建	153	日本・円	4,974,151,100	5,075,010,000	3.45

(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6月30日現在

種類	国/ 地域	取引 所 等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価 (円)	評価額	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価 指数 先物 取引	イギ リス	IC E- EU	F T S E 1 0 O I D X F U T S E P 2 3 2023年9月	買建	46	イギリ ス・ポ ンド	3,490,237.00	638,538,859	3,441,720.00	629,662,674	0.11
	ドイ ツ	EU RE OX	EUR O S T O X X 5 0 S E P 2 3 2023年9月	買建	316	ユーロ	13,808,667.00	2,176,245,919	13,840,800.00	2,181,310,080	0.39
	アメ リカ	シカ ゴ商 品取 引所	S & P 5 0 0 E M I N I F U T S E P 2 3 2023年9月	買建	348	アメリ カ・ド ル	76,866,131.50	11,144,820,406	77,182,050.00	11,190,625,429	2.01
	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 S E P 2 3 2023年 9月	買建	29	オー スト ラリ ア・ド ル	5,179,305.50	496,022,087	5,186,650.00	496,725,470	0.09

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2023年6月30日現在

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	買建	10,755,000.00	1,548,258,853	1,558,538,518	0.28
	ユーロ	買建	1,088,000.00	171,274,519	171,408,830	0.03
	イギリス・ポンド	買建	340,000.00	62,293,168	62,176,004	0.01
	スイス・フラン	買建	280,000.00	45,056,004	45,126,144	0.01
	カナダ・ドル	買建	375,000.00	40,825,575	40,974,675	0.01
	オーストラリア・ドル	買建	306,000.00	29,314,249	29,294,665	0.01
	スウェーデン・クローナ	買建	2,186,000.00	29,239,280	29,187,253	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6月30日現在

種類	国 / 地域	取引所等	名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価 (円)	評価額	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価 指数 先物 取引	アメ リカ	I C E - U S	M S C I E M G M K T S E P 2 3 2023 年9月	買建	498	アメ リカ・ド ル	25,370,308.00	3,678,440,956	24,658,470.00	3,575,231,565	10.30

(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6月30日現在

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	買建	381,880.63	54,900,000	55,343,744	0.16

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

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

2023年6月30日現在

種類	国 / 地域	取引所等	名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
リート指 数先物取 引	日本	大阪取引 所	T R E I T 先 物 0 5 0 9 月 2 0 2 3 年 9 月	買建	20	日本・円	36,732,400	36,860,000	0.30

(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6月30日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	買建	238,388.96	34,300,000	34,545,559	0.12

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

ゴールド・インデックス・マザーファンド

2023年6月30日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	買建	135,000.00	19,564,551	19,564,767	0.33

(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6月30日

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

基準価額・純資産の推移

■TOPIXインデックス



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

分配の推移

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

※分配金は1万口当たり、税引前です。

■225インデックス



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

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

※分配金は1万口当たり、税引前です。

■先進国株インデックス



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

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

※分配金は1万口当たり、税引前です。

■新興国株インデックス



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

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

※分配金は1万口当たり、税引前です。

■先進国債インデックス



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

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

※分配金は1万口当たり、税引前です。

■新興国債インデックス

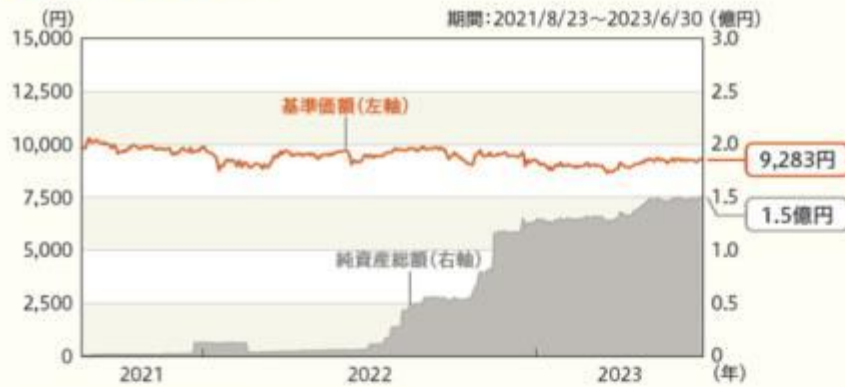


※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

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

※分配金は1万口当たり、税引前です。

■Jリートインデックス

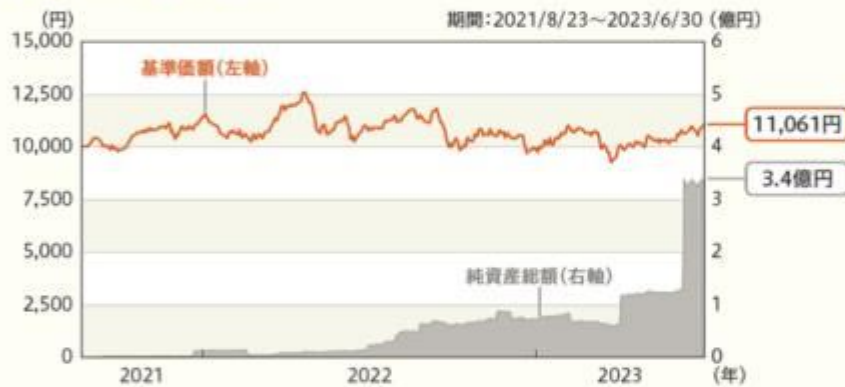


※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

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

※分配金は1万口当たり、税引前です。

■Gリートインデックス



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

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

※分配金は1万口当たり、税引前です。

■ゴールドインデックスヘッジ有



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

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

※分配金は1万口当たり、税引前です。

主要な資産の状況

■TOPIXインデックス

資産別構成

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

主要投資銘柄(上位10銘柄)

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

■国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	日本	98.35
新株予約権証券	日本	0.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.65
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て1.58%

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	3.81
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2.76
日本	株式	キーエンス	電気機器	2.04
日本	株式	三井FJフィナンシャルグループ	銀行業	1.97
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.65
日本	株式	三菱商事	卸売業	1.36
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.33
日本	株式	日立製作所	電気機器	1.31
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	1.31
日本	株式	任天堂	その他製品	1.24

■225インデックス

資産別構成

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

主要投資銘柄(上位10銘柄)

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

■225マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	日本	96.54
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3.46
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て3.45%

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	10.86
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	6.08
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	4.01
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	3.78
日本	株式	ダイキン工業	機械	2.88
日本	株式	KDDI	情報・通信業	2.63
日本	株式	ファナック	電気機器	2.48
日本	株式	信越化学工業	化学	2.35
日本	株式	テルモ	精密機器	1.80
日本	株式	TDK	電気機器	1.65

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

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

■先進国株インデックス

資産別構成

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

■外国株式インデックス・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	アメリカ	67.74
	イギリス	3.98
	カナダ	3.39
	フランス	3.22
	スイス	3.16
	ドイツ	2.42
	その他	11.40
投資証券	アメリカ・その他	2.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.61
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て2.61%

■新興国株インデックス

資産別構成

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

■エマージング株式インデックス・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	ケイマン諸島	14.89
	台湾	13.74
	インド	13.10
	韓国	11.01
	その他	25.31
投資証券	アメリカ	6.41
	その他	0.80
投資信託受益証券	香港	4.37
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		10.38
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て10.30%

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

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

主要投資銘柄(上位10銘柄)

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

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/半導体	5.55
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4.38
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費サービス/流通/小売	2.18
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	1.87
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	1.36
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	1.31
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1.19
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	1.15
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	0.82
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	0.81

主要投資銘柄(上位10銘柄)

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

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	6.10
香港	投資信託受益証券	CHINAAMC ETF SERIES - CHQNY	-	4.37
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	-	3.75
ケイマン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	3.56
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー/ハードウェア/半導体	3.53
ケイマン諸島	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費サービス/流通/小売	2.33
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	1.27
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI UAE ETF	-	1.15
ケイマン諸島	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	1.09
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK.H	銀行	0.83

■先進国債インデックス

資産別構成

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

■外国債券パッシブ・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	アメリカ	48.52
	フランス	8.15
	イタリヤ	7.50
	ドイツ	6.51
	中国	5.33
	スペイン	5.06
	イギリス	4.75
	その他	12.89
	現金・預金・その他の資産(負債控除後)	
合計(純資産総額)		100.00

■新興国債インデックス

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	98.39
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.61
合計(純資産総額)		100.00

■米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	サウジアラビア	9.70
	メキシコ	8.83
	アラブ首長国連邦	8.13
	カタール	8.01
	トルコ	7.49
	ブラジル	7.09
	ドミニカ共和国	6.21
	その他	42.34
	現金・預金・その他の資産(負債控除後)	
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

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

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2026/05/15	0.92
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2026/03/31	0.67
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.690	2026/08/12	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.125	2031/02/15	0.61
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	2026/08/31	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.625	2027/12/31	0.53
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	3.020	2031/05/27	0.53
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	3.720	2051/04/12	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.875	2030/11/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.625	2030/08/15	0.48

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド	98.39

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
サウジアラビア	国債証券	SAUDI INTERNATIONAL BOND	2.250	2033/02/02	4.58
ドミニカ共和国	国債証券	DOMINICAN REPUBLIC	6.000	2033/02/22	3.91
アラブ首長国連邦	国債証券	ABU DHABI GOVT INT'L	1.875	2031/09/15	3.84
カタール	国債証券	STATE OF QATAR	3.750	2030/04/16	3.76
オマーン	国債証券	OMAN GOV INTERNL BOND	6.250	2031/01/25	3.60
カタール	国債証券	STATE OF QATAR	4.400	2050/04/16	3.56
メキシコ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2.659	2031/05/24	3.52
ペルー	国債証券	REPUBLIC OF PERU	2.783	2031/01/23	3.02
トルコ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	9.875	2028/01/15	2.89
メキシコ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	5.000	2051/04/27	2.74

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

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

■Jリートインデックス

資産別構成

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

主要投資銘柄(上位10銘柄)

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

■Jリート・インデックス・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
投資証券	日本	98.93
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.07
合計(純資産総額)		100.00

※リート指数先物取引の買建て0.30%

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	6.21
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	5.28
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	5.05
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	4.73
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	4.57
日本	投資証券	GLP投資法人	4.51
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	3.91
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	3.33
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	3.24
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	3.06

■Gリートインデックス

資産別構成

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

主要投資銘柄(上位10銘柄)

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

■外国リート・インデックス・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
投資証券	アメリカ	77.23
	オーストラリア	6.42
	イギリス	4.33
	シンガポール	3.58
	フランス	1.69
	カナダ	1.66
	香港	1.33
	その他	2.44
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.32
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	8.75
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	5.66
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	3.55
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	3.18
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	3.13
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	2.93
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	2.54
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	2.46
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	2.09
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	1.76

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

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

■ゴールドインデックスヘッジ用

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	102.20
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△2.20
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	ゴールド・インデックス・マザーファンド	102.20

■ゴールド・インデックス・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	99.20
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.80
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
アメリカ	投資信託受益証券	SPDR Gold Minishares Trust	76.92
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES GOLD TRUST	22.28

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

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

年間収益率の推移(暦年ベース)

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



■225インデックス(ベンチマーク:日経平均株価(日経225))



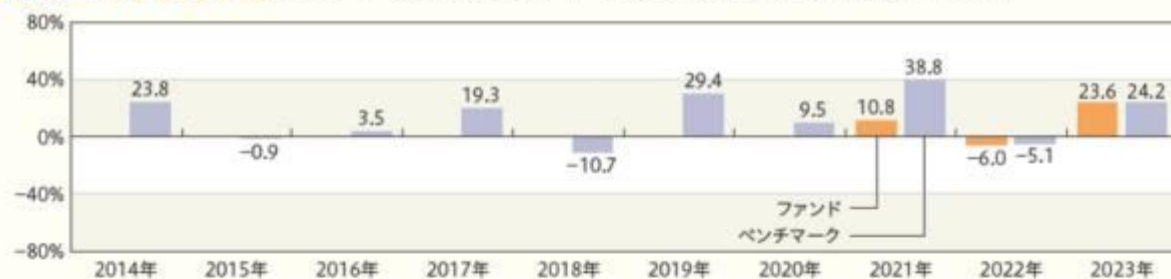
※ファンドの収益率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しています。分配実績がない場合は、基準価額の騰落率です。

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

※2023年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。

※ベンチマークの情報は参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

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



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



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



■新興国債インデックス(ベンチマーク:JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース))



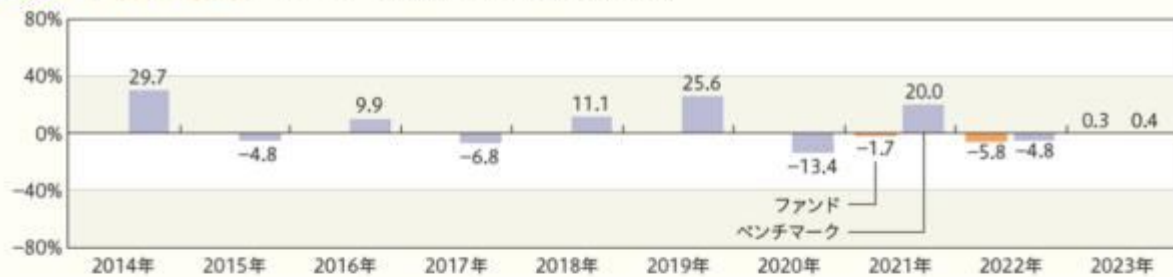
※ファンドの収益率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しています。分配実績がない場合は、基準価額の騰落率です。

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

※2023年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。

※ベンチマークの情報は参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

■Jリートインデックス(ベンチマーク:東証REIT指数(配当込み))



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



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



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

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

※2023年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。

※ベンチマークの情報は参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

イ 申込方法

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

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」の2つの申込方法がありますが、販売会社によってはいずれか一方のみの取扱いとなる場合があります。販売会社によっては、「スイッチング」（ある投資信託の換金による手取額をもって、他の投資信託を買い付けること）による当ファンドの取得申込みを取り扱う場合があります。お申込みの販売会社にお問い合わせください。

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

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

(ハ) 当ファンドの取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ当該取得申込者

が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

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

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

(二) 申込不可日

上記にかかわらず、各ファンドにつき、取得申込日が以下の申込不可日に当たる場合には、ファンドの取得申込みはできません（また、該当日には、解約請求のお申込みもできません。）。

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

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

ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

ハ 申込手数料

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

累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は無手数料となります。

申込手数料に関する詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

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、以下の申込不可日に当たる場合には、解約請求の受け付けは行いません。

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

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

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

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

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して6営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

イ 基準価額の算出方法

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

<主要投資対象の評価方法>

「各マザーファンド（ゴールド・インデックス・マザーファンドを除く）」

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

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

「ゴールド・インデックス・マザーファンド」

主要投資対象	有価証券等の評価方法
投資信託証券	原則として、基準価額計算日に知りうる直近の純資産価格（基準価額）で評価します。また、上場されている場合は、その主たる取引所における最終相場で評価します。

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

ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

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

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

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

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

(2) 【保管】

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

(3) 【信託期間】

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

(4) 【計算期間】

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

(5) 【その他】

イ 信託の終了

(イ) 信託契約の解約

- a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、各ファンドの残存口数が30億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記aの事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b～dまでの取扱いは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b～dまでの取扱いを行うことが困難な場合も同様とします。

(ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令

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

(八) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

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

(二) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

ロ 収益分配金、償還金の支払い

(イ) 収益分配金

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

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

(ロ) 償還金

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

八 信託約款の変更等

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

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

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

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

二 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

ホ 販売会社との契約の更改等

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

へ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

ト 公告

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

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

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

チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ 分配金請求権

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

収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として決算日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日

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

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

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

ロ 償還金請求権

受益者は、持分に依りて償還金を請求する権利を有します。

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

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

ハ 一部解約実行請求権

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

ニ 書面決議における議決権

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

ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期(2021年12月1日から2022年11月30日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

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

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

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

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

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

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

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

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	第2期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

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

金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期 (2022年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自2021年8月23日 至 2021年11月30日)

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

第2期(自2021年12月1日 至 2022年11月30日)

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

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

(その他の注記)

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

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	18,140,230	61,811,019	
	親投資信託受益証券 小計		61,811,019	
合計			61,811,019	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【三井住友D S ・日経225インデックス・ファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

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

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

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

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

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

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

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

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	第2期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

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

金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期 (2022年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自2021年8月23日 至 2021年11月30日)

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

第2期(自2021年12月1日 至 2022年11月30日)

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

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

(その他の注記)

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

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

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

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【三井住友D S ・先進国株式インデックス・ファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位 : 円)

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

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

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

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

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

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

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

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	第2期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

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

金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期 (2022年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自2021年8月23日 至 2021年11月30日)

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

第2期(自2021年12月1日 至 2022年11月30日)

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

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

(その他の注記)

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

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

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

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【三井住友D S ・新興国株式インデックス・ファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位 : 円)

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

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期		第2期	
	自	2021年 8月23日 至 2021年11月30日	自	2021年12月 1日 至 2022年11月30日
営業収益				
有価証券売買等損益		67,098		502,275
営業収益合計		67,098		502,275
営業費用				
受託者報酬		93		2,814
委託者報酬		2,355		59,220
その他費用		-		861
営業費用合計		2,448		62,895
営業利益又は営業損失 ()		69,546		565,170
経常利益又は経常損失 ()		69,546		565,170
当期純利益又は当期純損失 ()		69,546		565,170
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 ()		-		516,037
期首剰余金又は期首欠損金 ()		-		64,352
剰余金増加額又は欠損金減少額		133,898		-
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		133,898		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		78,208
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		9,647
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		68,561
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ()		64,352		62,989

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	第1期	第2期
	(2021年11月30日現在)	(2022年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,960,151口	22,559,233口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	元本の欠損 62,989円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0217円 (1万口当たりの純資産額10,217円)	1口当たり純資産額 0.9972円 (1万口当たりの純資産額9,972円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

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

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項 目	第2期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

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

金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期 (2022年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自2021年8月23日 至 2021年11月30日)

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

第2期(自2021年12月1日 至 2022年11月30日)

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

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

(その他の注記)

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

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

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

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【三井住友D S ・先進国債インデックス・ファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位 : 円)

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

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期		第2期	
	自	2021年 8月23日 至 2021年11月30日	自	2021年12月 1日 至 2022年11月30日
営業収益				
有価証券売買等損益		30,456		1,387,274
営業収益合計		30,456		1,387,274
営業費用				
受託者報酬		339		4,891
委託者報酬		4,253		61,901
その他費用		51		1,094
営業費用合計		4,643		67,886
営業利益又は営業損失 ()		25,813		1,455,160
経常利益又は経常損失 ()		25,813		1,455,160
当期純利益又は当期純損失 ()		25,813		1,455,160
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 ()		-		263,394
期首剰余金又は期首欠損金 ()		-		25,013
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		1,567,191
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		1,567,191
剰余金減少額又は欠損金増加額		800		107,341
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		107,341
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		800		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ()		25,013		293,097

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

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

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

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

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	第2期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

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

金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期 (2022年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自2021年8月23日 至 2021年11月30日)

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

第2期(自2021年12月1日 至 2022年11月30日)

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

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

(その他の注記)

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

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

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

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【三井住友D S ・新興国債インデックス・ファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位 : 円)

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

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期		第2期	
	自	2021年 8月23日 至 2021年11月30日	自	2021年12月 1日 至 2022年11月30日
営業収益				
有価証券売買等損益		16,237		507,186
営業収益合計		16,237		507,186
営業費用				
受託者報酬		86		1,578
委託者報酬		1,824		33,501
その他費用		-		408
営業費用合計		1,910		35,487
営業利益又は営業損失()		18,147		542,673
経常利益又は経常損失()		18,147		542,673
当期純利益又は当期純損失()		18,147		542,673
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		-		286
期首剰余金又は期首欠損金()		-		13,240
剰余金増加額又は欠損金減少額		4,907		-
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		4,907		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		467,601
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		62
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		467,539
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		13,240		1,023,228

（ 3 ）【注記表】

（重要な会計方針の注記）

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項 目	第1期	第2期
	(2021年11月30日現在)	(2022年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,621,093口	12,592,578口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 13,240円	元本の欠損 1,023,228円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9918円 (1万口当たりの純資産額9,918円)	1口当たり純資産額 0.9187円 (1万口当たりの純資産額9,187円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

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

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項 目	第2期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

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

金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期 (2022年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自 2021年8月23日 至 2021年11月30日)

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

第2期(自 2021年12月1日 至 2022年11月30日)

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

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

(その他の注記)

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

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

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

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【三井住友D S ・国内リートインデックス・ファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位 : 円)

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

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

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

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

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

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

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

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項 目	第2期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

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

金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期 (2022年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自2021年8月23日 至 2021年11月30日)

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

第2期(自2021年12月1日 至 2022年11月30日)

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

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

(その他の注記)

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

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	43,763,199	118,143,132	
	親投資信託受益証券 小計		118,143,132	
合計			118,143,132	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【三井住友D S ・先進国リートインデックス・ファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位 : 円)

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

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期		第2期	
	自	2021年 8月23日 至 2021年11月30日	自	2021年12月 1日 至 2022年11月30日
営業収益				
有価証券売買等損益		143,124		3,749,709
営業収益合計		143,124		3,749,709
営業費用				
受託者報酬		96		6,385
委託者報酬		2,375		132,753
その他費用		-		1,759
営業費用合計		2,471		140,897
営業利益又は営業損失 ()		140,653		3,890,606
経常利益又は経常損失 ()		140,653		3,890,606
当期純利益又は当期純損失 ()		140,653		3,890,606
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 ()		-		226,848
期首剰余金又は期首欠損金 ()		-		163,300
剰余金増加額又は欠損金減少額		22,647		9,272,153
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		22,647		9,272,153
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		872,455
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		872,455
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ()		163,300		4,899,240

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

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

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

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

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	第2期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

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

金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期 (2022年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自2021年8月23日 至 2021年11月30日)

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

第2期(自2021年12月1日 至 2022年11月30日)

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

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

(その他の注記)

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

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

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

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【三井住友D S ・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)】

(1) 【貸借対照表】

(単位 : 円)

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

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	2021年 8月23日 至 2021年11月30日	自	2021年12月 1日 至 2022年11月30日
営業収益				
有価証券売買等損益		556,279		12,605,879
為替差損益		355,937		28,689,850
営業収益合計		912,216		16,083,971
営業費用				
受託者報酬		829		35,110
委託者報酬		14,041		580,576
その他費用		7,910		16,282
営業費用合計		22,780		631,968
営業利益又は営業損失（ ）		934,996		16,715,939
経常利益又は経常損失（ ）		934,996		16,715,939
当期純利益又は当期純損失（ ）		934,996		16,715,939
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		-		229,995
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		972,728
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		37,732		8,704,867
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		1,338,189
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		37,732		7,366,678
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		972,728		26,163,539

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第1期	第2期
	(2021年11月30日現在)	(2022年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	38,535,757口	361,645,871口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 972,728円	元本の欠損 26,163,539円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9748円 (1万口当たりの純資産額9,748円)	1口当たり純資産額 0.9277円 (1万口当たりの純資産額9,277円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

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

分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(0円)、および分配準備積立金(0円)より、分配対象収益は0円(1万口当たり0.00円)ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(0円)、および分配準備積立金(0円)より、分配対象収益は0円(1万口当たり0.00円)ですが、分配を行っておりません。
----------	---	---

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	第2期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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2期 (2022年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期(自 2021年8月23日 至 2021年11月30日)

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

合計	572,946円
----	----------

第2期(自2021年12月1日至2022年11月30日)

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

(デリバティブ取引に関する注記)

第1期(2021年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	40,145,441	-	39,927,739	217,702
	小計	40,145,441	-	39,927,739	217,702
合計		40,145,441	-	39,927,739	217,702

第2期(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	327,357,536	-	326,040,745	1,316,791
	小計	327,357,536	-	326,040,745	1,316,791
合計		327,357,536	-	326,040,745	1,316,791

(注)1.時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

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

(その他の注記)

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

(4) 【 附属明細表 】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位 : 円)

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

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

(参考)

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

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

（1）貸借対照表

（単位：円）

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

（2）注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	（2021年11月30日現在）	（2022年11月30日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	61,173,269,127口	65,393,298,021口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.2212円 （1万口当たりの純資産額32,212円）	1口当たり純資産額 3.4074円 （1万口当たりの純資産額34,074円）

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項 目	(2022年11月30日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券（株式）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p>

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

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

(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

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

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

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

(その他の注記)

(2021年11月30日現在)

開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	60,972,880,728円
同期中における追加設定元本額	3,082,168,879円
同期中における一部解約元本額	2,881,780,480円
2021年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,444,432,886円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	893,111,379円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,314,610,252円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,302,572,824円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	123,293,850円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	4,679,600円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	20,378,358円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	62,968,056円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	145,617,764円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	123,379,159円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	223,865,395円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,383,108,545円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	18,142,394,620円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	277,082,196円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	326,588,940円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	215,307,143円
イオン・バランス戦略ファンド	14,508,106円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	29,487,863円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	154,290,540円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	142,287,008円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	489,286,600円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	261,074,601円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	295,921,518円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	33,623,909円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	440,586,720円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	14,302,327円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	71,078,321円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	69,299,615円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	4,018,342円
日興FWS・日本株インデックス	300,009,523円
三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド	1,878,586円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,839,797,359円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	12,523,734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>	108,824,691円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	1,852,669,865円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	1,648,623,694円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	6,291,332,987円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	41,040,556円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	166,358,728円
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	748,263,991円

S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	46,344,355円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	259,277,705円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	856,981,897円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	603,670,244円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	1,898,722,676円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	374,931円
S M A M ・ グローバルバランス4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	42,261,700円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	47,434,130円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	34,163,089円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	16,669,461円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	115,063,306円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	248,882,682円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	61,933,489円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	39,574,438円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	7,375,595円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 0 L 2 < 適格機関投資家専用 >	45,508,490円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	613,464,436円
S M A M ・ 国内株式インデックスファンド・ V A (適格機関投資家専用)	180,359,966円
S M A M ・ グローバルバランスファンド (標準型) V A < 適格機関投資家限定 >	237,022,466円
S M A M ・ グローバルバランスファンド (債券重視型) V A < 適格機関投資家限定 >	110,132,461円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	259,324,316円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	64,476,018円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	37,709,634円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	55,155,389円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	59,877,017円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	197,029,085円
合 計	61,173,269,127円

(2022年11月30日現在)

開示対象ファンドの

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

2022年11月30日現在の元本の内訳

三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,574,760,676円
三井住友・D C 年金バランス3 0 (債券重点型)	1,036,137,254円
三井住友・D C 年金バランス5 0 (標準型)	4,637,683,641円
三井住友・D C 年金バランス7 0 (株式重点型)	3,605,989,911円
S M A M ・ グローバルバランスファンド (機動的資産配分型)	147,542,223円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 2 0 (4 資産タイプ)	4,234,860円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 2 5 (4 資産タイプ)	19,508,324円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 3 0 (4 資産タイプ)	63,979,125円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 3 5 (4 資産タイプ)	165,870,052円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 4 0 (4 資産タイプ)	149,775,143円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 4 5 (4 資産タイプ)	266,593,539円
国内株式指数ファンド (T O P I X)	1,398,015,768円

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	22,016,808,347円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	179,974,667円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	253,617,658円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	167,938,880円
イオン・バランス戦略ファンド	20,272,782円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	41,931,085円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	191,067,731円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	178,416,019円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	669,872,498円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	375,434,831円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	427,891,807円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	49,851,584円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	813,757,842円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	39,664,361円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	202,349,704円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	191,586,051円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	5,500,206円
日興FWS・日本株インデックス	1,276,658,198円
三井住友D S・TOPIXインデックス・ファンド	18,140,230円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,564,092,115円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	11,882,906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>	74,050,540円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	1,456,182,387円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	1,446,188,375円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	5,623,103,466円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	37,493,396円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	135,694,110円
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	684,565,549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>	44,118,775円
SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	254,234,553円
SMAM・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>	796,235,497円
SMAM・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>	533,449,238円
SMAM・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>	1,657,079,267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>	36,667,207円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	39,482,192円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用>	32,479,210円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用>	16,795,425円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用>	95,429,547円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用>	219,105,114円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2 <適格機関投資家専用>	52,522,560円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2 <適格機関投資家専用>	38,723,328円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2 <適格機関投資家専用>	7,680,964円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2 <適格機関投資家専用>	41,326,285円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2 <適格機関投資家専用>	542,525,688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)	167,317,059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>	202,591,112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>	85,721,825円

S M A M ・世界バランスファンドV A <適格機関投資家限定>	94,168,528円
S M A M ・世界バランスファンドV A 2 <適格機関投資家限定>	44,811,453円
S M A M ・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	42,807,427円
S M A M ・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	5,577,900円
S M A M ・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	7,187,543円
S M A M ・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド <適格機関投資家限定>	92,673,351円
S M D A M ・日米3資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	18,136,348円
合 計	65,393,298,021円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

(単位:円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
極 洋	3,900	3,695.000	14,410,500	
日本水産	106,900	522.000	55,801,800	
マルハニチロ	16,200	2,456.000	39,787,200	
雪国まいたけ	10,600	1,001.000	10,610,600	
カネコ種苗	5,300	1,429.000	7,573,700	
サカタのタネ	13,500	4,690.000	63,315,000	
ホクト	9,400	1,890.000	17,766,000	
住石ホールディングス	21,800	254.000	5,537,200	
日鉄鉱業	4,300	3,145.000	13,523,500	
三井松島HLDGS	5,000	3,225.000	16,125,000	
I N P E X	394,000	1,533.000	604,002,000	
石油資源開発	12,300	4,335.000	53,320,500	
K & O エナジーグループ	4,900	2,427.000	11,892,300	
ショーボンドHD	14,500	6,060.000	87,870,000	
ミライト・ワン	37,200	1,514.000	56,320,800	
タマホーム	7,600	2,479.000	18,840,400	
日本アクア	5,900	880.000	5,192,000	
ROBOT HOME	800	184.000	147,200	
安藤・間	61,900	874.000	54,100,600	
東急建設	32,600	656.000	21,385,600	
コムシスホールディングス	35,900	2,467.000	88,565,300	
ビーアールホールディングス	22,200	337.000	7,481,400	
高松建設	7,200	1,960.000	14,112,000	
東建コーポレーション	3,400	7,950.000	27,030,000	
ヤマウラ	7,600	1,004.000	7,630,400	
オリエンタル白石	41,300	278.000	11,481,400	
大成建設	74,200	4,165.000	309,043,000	
大 林 組	265,900	1,024.000	272,281,600	
清水建設	223,600	738.000	165,016,800	
飛鳥建設	10,400	1,022.000	10,628,800	
長谷工コーポレーション	76,900	1,517.000	116,657,300	

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

関西電力	292,300	1,166.000	340,821,800
中国電力	121,900	715.000	87,158,500
北陸電力	73,700	537.000	39,576,900
東北電力	186,200	653.000	121,588,600
四国電力	65,800	753.000	49,547,400
九州電力	174,300	718.000	125,147,400
北海道電力	75,200	454.000	34,140,800
沖縄電力	19,100	1,054.000	20,131,400
電源開発	57,500	2,118.000	121,785,000
エフオン	6,800	548.000	3,726,400
イーレックス	13,500	2,522.000	34,047,000
レノバ	20,300	2,731.000	55,439,300
東京瓦斯	160,600	2,526.000	405,675,600
大阪瓦斯	153,600	2,122.000	325,939,200
東邦瓦斯	30,000	2,691.000	80,730,000
北海道瓦斯	5,000	1,692.000	8,460,000
広島ガス	13,700	340.000	4,658,000
西部ガスH L D G S	7,100	1,678.000	11,913,800
静岡ガス	17,000	1,100.000	18,700,000
メタウォーター	9,400	1,789.000	16,816,600
S B Sホールディングス	6,600	2,965.000	19,569,000
東武鉄道	83,100	3,310.000	275,061,000
相鉄ホールディングス	25,400	2,190.000	55,626,000
東急	212,200	1,749.000	371,137,800
京浜急行	86,600	1,440.000	124,704,000
小田急電鉄	115,000	1,802.000	207,230,000
京王電鉄	40,200	5,120.000	205,824,000
京成電鉄	48,900	3,915.000	191,443,500
富士急行	9,400	4,920.000	46,248,000
東日本旅客鉄道	129,100	7,811.000	1,008,400,100
西日本旅客鉄道	97,500	5,836.000	569,010,000
東海旅客鉄道	58,700	16,630.000	976,181,000
西武ホールディングス	92,400	1,380.000	127,512,000
鴻池運輸	13,100	1,581.000	20,711,100
西日本鉄道	20,200	2,806.000	56,681,200
ハマキョウレックス	5,900	3,425.000	20,207,500
サカイ引越センター	3,700	4,595.000	17,001,500
近鉄グループH L D G S	75,700	4,900.000	370,930,000
阪急阪神H L D G S	100,700	4,290.000	432,003,000
南海電鉄	36,400	3,010.000	109,564,000
京阪ホールディングス	31,400	3,460.000	108,644,000
神戸電鉄	2,800	3,235.000	9,058,000
名古屋鉄道	84,000	2,259.000	189,756,000
山陽電鉄	6,300	2,235.000	14,080,500
アルプス物流	6,000	1,160.000	6,960,000
ヤマトホールディングス	97,200	2,293.000	222,879,600
山 九	19,300	4,945.000	95,438,500
丸全昭和運輸	4,700	3,220.000	15,134,000

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

2 2 5 マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位 : 円)

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

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

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

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

	株式 674,000,000円	株式 808,100,000円
2. 当計算期間の末日における 受益権の総数	28,339,379,860口	34,776,887,242口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.6174円 (1万口当たりの純資産額36,174円)	1口当たり純資産額 3.7164円 (1万口当たりの純資産額37,164円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項 目	(2022年11月30日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券(株式) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

		契 約 額 等		
--	--	---------	--	--

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

(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

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

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

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

(その他の注記)

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

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

(2022年11月30日現在)

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

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

(単位:円)

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

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

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

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

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

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

(b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

外国株式インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

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

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

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	（2021年11月30日現在）	（2022年11月30日現在）
1. 当計算期間の末日における 受益権の総数	60,650,874,522口	72,186,242,919口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 5.8337円 （1万口当たりの純資産額58,337円）	1口当たり純資産額 6.1258円 （1万口当たりの純資産額61,258円）

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項 目	(2022年11月30日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券（株式、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

		契 約 額 等		
--	--	---------	--	--

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

(単位：円)

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

(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

		契 約 額 等		

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

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

- 2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(単位：円)

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

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

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

(その他の注記)

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

イオン・バランス戦略ファンド	26,039,960円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2 0 5 0	15,113,153円
三井住友・資産最適化ファンド(1 安定重視型)	110,598,046円
三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)	97,319,132円
三井住友・資産最適化ファンド(3 バランス型)	330,128,909円
三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)	170,705,412円
三井住友・資産最適化ファンド(5 成長重視型)	195,254,066円
三井住友・D C つみたてN I S A ・世界分散ファンド	38,559,109円
三井住友D S ・外国株式インデックス年金ファンド	509,621,059円
三井住友D S ・年金バランス3 0 (債券重点型)	4,097,387円
三井住友D S ・年金バランス5 0 (標準型)	17,354,910円
三井住友D S ・年金バランス7 0 (株式重点型)	15,630,593円
三井住友D S ・D C ターゲットイヤーファンド2 0 6 0	2,093,613円
S M B C ・D C インデックスファンド(M S C I コクサイ)	110,450,992円
日興F W S ・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	67,713,873円
日興F W S ・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	281,821,366円
三井住友D S ・先進国株式インデックス・ファンド	12,792,410円
S M A M ・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	591,445,429円
バランスファンドV A (安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	3,447,518円
S M A M ・バランスファンドV A 安定成長型 < 適格機関投資家限定 >	32,980,346円
S M A M ・バランスファンドV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	704,179,317円
S M A M ・バランスファンドV A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >	824,854,056円
S M A M ・バランスファンドV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	3,604,698,411円
S M A M ・バランスファンドV L 3 0 < 適格機関投資家限定 >	12,109,077円
S M A M ・バランスファンドV L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	64,600,386円
S M A M ・バランスファンドV A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	508,707,107円
S M A M ・バランスファンドV L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	41,029,721円
S M A M ・インデックス・バランスV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	102,099,408円
S M A M ・インデックス・バランスV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	495,008,013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 >	350,695,262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 >	829,398,471円
S M A M ・バランスV A 株4 0 T < 適格機関投資家限定 >	218,848円
三井住友・外国株式インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	218,605,667円
S M A M ・グローバルバランス4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	75,145,593円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	8,737,379円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	7,911,776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 >	4,096,558円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	21,448,701円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	60,189,060円
S M A M ・グローバルバランスファンド(標準型) V A < 適格機関投資家限定 >	139,958,110円
S M A M ・グローバルバランスファンド(債券重視型) V A < 適格機関投資家限定 >	63,429,174円
S M A M ・世界バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	817,767,596円
S M A M ・世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	118,979,244円
S M A M ・外国株式インデックスファンドS A < 適格機関投資家限定 >	1,028,620,924円
S M A M ・年金W リスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	27,233,124円
S M A M ・マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	37,994,675円
S M A M ・マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	41,244,635円

S M A M ・ マルチアセット ・ ダイナミックアロケーション ・ ストラテジー ・ ファンド < 適格機関投資家限定 >	222,731,531円
合 計	60,650,874,522円

(2022年11月30日現在)

開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	60,650,874,522円
同期中における追加設定元本額	22,050,143,482円
同期中における一部解約元本額	10,514,775,085円
2022年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	36,369,253,618円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	284,736,068円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,090,013,037円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	785,999,194円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	33,400,233円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	1,017,107円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	5,342,658円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	16,884,192円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	49,323,143円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	54,445,231円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	105,113,958円
外国株式指数ファンド	936,693,371円
三井住友・DCつみたてN I S A ・ 全海外株インデックスファンド	17,542,779,547円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	90,349,697円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	117,821,294円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	75,689,448円
イオン・バランス戦略ファンド	20,982,589円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2050	21,006,539円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	130,889,105円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	118,201,443円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	437,684,453円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	238,781,337円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	274,840,665円
三井住友・DCつみたてN I S A ・ 世界分散ファンド	54,612,889円
三井住友D S ・ 外国株式インデックス年金ファンド	1,637,991,448円
三井住友D S ・ 年金バランス30(債券重点型)	10,892,390円
三井住友D S ・ 年金バランス50(標準型)	47,697,547円
三井住友D S ・ 年金バランス70(株式重点型)	42,074,552円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2060	2,714,893円
S M B C ・ DCインデックスファンド(M S C I コクサイ)	397,450,005円
日興F W S ・ 先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	250,037,372円
日興F W S ・ 先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	1,466,576,467円
三井住友D S ・ 先進国株式インデックス・ファンド	50,536,075円
S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	449,296,410円
バランスファンドV A (安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	3,279,377円
S M A M ・ バランスファンドV A 安定成長型 < 適格機関投資家限定 >	20,004,315円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	536,704,870円

SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	702,957,041円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	3,074,190,088円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	9,972,101円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	49,989,232円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	423,311,736円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	36,093,954円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	90,939,599円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	427,001,205円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	293,567,068円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	687,726,675円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	200,225円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	194,459,687円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	59,953,329円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	7,255,976円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	6,951,628円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	3,833,026円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	17,103,227円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	51,782,752円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	110,286,434円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	46,890,632円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	281,352,925円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	80,381,144円
SMAM・外国株式インデックスファンドSA<適格機関投資家限定>	1,662,845,853円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	17,217,947円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	1,803,118円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	2,321,567円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	74,738,213円
合計	72,186,242,919円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	APA CORP	19,759	46.590	920,571.81	
	BAKER HUGHES CO	60,981	28.650	1,747,105.65	
	CHENIERE ENERGY INC	14,977	172.650	2,585,779.05	
	CHEVRON CORP	118,131	181.030	21,385,254.93	
	CONOCOPHILLIPS	82,511	124.250	10,251,991.75	
	COTERRA ENERGY INC	49,908	28.070	1,400,917.56	
	DEVON ENERGY CORP	40,169	67.500	2,711,407.50	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	11,049	146.740	1,621,330.26	
	EOG RESOURCES INC	37,069	141.290	5,237,479.01	
	EQT CORP	19,298	42.660	823,252.68	
	EXXON MOBIL CORP	267,258	110.540	29,542,699.32	

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

ADP	1,346	145.700	196,112.20
AENA SME SA	4,377	121.350	531,148.95
ATLANTIA SPA	26,501	22.930	607,667.93
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	33,148	7.592	251,659.61
DEUTSCHE POST AG-REG	62,178	37.840	2,352,815.52
GETLINK SE	30,428	15.905	483,957.34
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	20,347	84.750	1,724,408.25
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	3,679	80.150	294,871.85
CONTINENTAL AG	8,078	57.880	467,554.64
DR ING HC F PORSCHE AG	7,000	106.450	745,150.00
FERRARI NV	7,986	208.500	1,665,081.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	52,242	62.540	3,267,214.68
MICHELIN (CGDE)	45,659	26.440	1,207,223.96
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	10,089	58.000	585,162.00
RENAULT SA	14,764	33.780	498,727.92
STELLANTIS NV	139,238	14.710	2,048,190.98
VALEO	14,444	17.630	254,647.72
VOLKSWAGEN AG	1,960	181.700	356,132.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	11,844	137.840	1,632,576.96
ADIDAS AG	10,395	120.940	1,257,171.30
HERMES INTERNATIONAL	1,973	1,484.000	2,927,932.00
KERING	4,759	552.600	2,629,823.40
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	17,700	702.000	12,425,400.00
MONCLER SPA	12,209	48.000	586,032.00
PUMA SE	6,459	47.850	309,063.15
SEB SA	1,127	76.800	86,553.60
ACCOR SA	10,451	24.880	260,020.88
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	11,019	138.650	1,527,784.35
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,785	37.410	216,416.85
SODEXO SA	4,760	91.040	433,350.40
DELIVERY HERO SE	8,530	39.380	335,911.40
D'IETEREN GROUP	1,449	178.000	257,922.00
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	71,341	24.920	1,777,817.72
JUST EAT TAKEAWAY	12,903	20.940	270,188.82
PROSUS NV	51,027	60.270	3,075,397.29
ZALANDO SE	12,367	29.250	361,734.75
CARREFOUR SA	35,990	16.510	594,194.90
HELLOFRESH SE	9,790	22.660	221,841.40
JERONIMO MARTINS	17,393	21.340	371,166.62
KESKO OYJ-B SHS	20,250	20.530	415,732.50
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	64,661	27.940	1,806,628.34
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	56,632	56.200	3,182,718.40
DANONE	40,711	50.300	2,047,763.30
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	35,407	10.035	355,309.24

HEINEKEN HOLDING NV	6,168	72.500	447,180.00
HEINEKEN NV	16,091	88.700	1,427,271.70
JDE PEET'S NV	6,660	29.200	194,472.00
KERRY GROUP PLC-A	9,894	90.860	898,968.84
PERNOD RICARD SA	13,733	186.950	2,567,384.35
REMY COINTREAU	1,273	161.800	205,971.40
BEIERSDORF AG	6,813	102.950	701,398.35
HENKEL AG & CO KGAA	5,974	64.500	385,323.00
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	10,398	68.380	711,015.24
L'OREAL	15,195	347.500	5,280,262.50
AMPLIFON SPA	7,567	27.110	205,141.37
BIOMERIEUX	2,791	96.060	268,103.46
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,161	126.900	274,230.90
DIASORIN SPA	1,313	128.900	169,245.70
ESSILORLUXOTTICA	17,807	175.500	3,125,128.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	13,613	29.660	403,761.58
FRESENIUS SE & CO KGAA	23,254	26.270	610,882.58
KONINKLIJKE PHILIPS NV	52,727	14.080	742,396.16
SIEMENS HEALTHINEERS AG	16,426	50.440	828,527.44
ARGENX SE	3,503	364.300	1,276,142.90
BAYER AG-REG	63,781	55.960	3,569,184.76
EUROFINS SCIENTIFIC	9,270	67.040	621,460.80
GRIFOLS SA	15,169	9.944	150,840.53
IPSEN	1,498	108.800	162,982.40
MERCK KGAA	7,777	172.100	1,338,421.70
ORION OYJ-CLASS B	6,261	50.420	315,679.62
QIAGEN N.V.	15,665	47.180	739,074.70
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	8,068	40.010	322,800.68
SANOFI	73,053	88.190	6,442,544.07
SARTORIUS AG-VORZUG	1,682	353.400	594,418.80
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,555	315.700	490,913.50
UCB SA	7,782	77.140	600,303.48
ABN AMRO BANK NV-CVA	28,787	12.280	353,504.36
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	420,232	5.624	2,363,384.76
BANCO SANTANDER SA	1,046,474	2.835	2,966,753.79
BNP PARIBAS	72,020	53.570	3,858,111.40
CAIXABANK SA	290,777	3.548	1,031,676.79
COMMERZBANK AG	60,640	8.012	485,847.68
CREDIT AGRICOLE SA	73,102	9.606	702,217.81
ERSTE GROUP BANK AG	20,506	29.420	603,286.52
FINECOBANK SPA	43,093	15.120	651,566.16
ING GROEP NV	254,105	11.662	2,963,372.51
INTESA SANPAOLO	1,011,886	2.134	2,159,364.72
KBC GROUP NV	14,910	52.520	783,073.20

MEDIOBANCA SPA	47,708	9.256	441,585.24
SOCIETE GENERALE SA	48,558	24.075	1,169,033.85
UNICREDIT SPA	127,961	12.960	1,658,374.56
AMUNDI SA	3,955	52.600	208,033.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	127,233	10.210	1,299,048.93
DEUTSCHE BOERSE AG	11,916	172.500	2,055,510.00
EURAZEO SE	1,792	60.500	108,416.00
EURONEXT NV	5,502	71.780	394,933.56
EXOR NV	6,204	73.900	458,475.60
GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	5,914	77.060	455,732.84
SOFINA	804	211.000	169,644.00
WENDEL	1,082	87.050	94,188.10
AEGON NV	127,748	4.670	596,583.16
AGEAS	11,247	37.810	425,249.07
ALLIANZ SE-REG	26,307	205.600	5,408,719.20
ASSICURAZIONI GENERALI	72,382	16.940	1,226,151.08
AXA SA	119,547	27.355	3,270,208.18
HANNOVER RUECK SE	3,598	181.200	651,957.60
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	9,023	301.500	2,720,434.50
NN GROUP NV	16,917	40.330	682,262.61
POSTE ITALIANE SPA	34,720	9.422	327,131.84
SAMPO OYJ-A SHS	29,843	48.330	1,442,312.19
AROUNDTOWN SA	73,508	2.336	171,714.68
LEG IMMOBILIEN SE	4,538	61.560	279,359.28
VONOVIA SE	46,339	23.800	1,102,868.20
ADYEN NV	1,394	1,427.000	1,989,238.00
AMADEUS IT GROUP SA	29,928	50.860	1,522,138.08
BECHTLE AG	4,305	34.010	146,413.05
CAPGEMINI SE	10,453	172.750	1,805,755.75
DASSAULT SYSTEMES SE	40,049	34.755	1,391,902.99
EDENRED	14,650	52.620	770,883.00
NEMETSCHKE SE	3,011	45.650	137,452.15
NEXI SPA	30,853	8.340	257,314.02
SAP SE	66,988	103.080	6,905,123.04
WORLDLINE SA	16,677	44.810	747,296.37
NOKIA OYJ	348,610	4.571	1,593,496.31
ASM INTERNATIONAL NV	3,170	256.150	811,995.50
ASML HOLDING NV	25,752	559.800	14,415,969.60
INFINEON TECHNOLOGIES AG	79,641	30.600	2,437,014.60
STMICROELECTRONICS NV	43,538	35.750	1,556,483.50
CELLNEX TELECOM SA	32,830	32.610	1,070,586.30
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	208,285	19.464	4,054,059.24
ELISA OYJ	10,160	49.560	503,529.60
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,804	9.386	148,336.34

KONINKLIJKE KPN NV	222,179	2.911	646,763.06	
ORANGE	127,798	9.844	1,258,043.51	
PROXIMUS	10,895	10.155	110,638.72	
TELECOM ITALIA SPA	696,355	0.217	151,109.03	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	79,654	2.268	180,655.27	
TELEFONICA SA	335,910	3.590	1,205,916.90	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,269	19.140	100,848.66	
ACCIONA SA	1,810	181.300	328,153.00	
E.ON SE	147,318	9.086	1,338,531.34	
EDF	32,658	12.000	391,896.00	
EDP RENOVAVEIS SA	17,764	21.730	386,011.72	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	195,232	4.420	862,925.44	
ELIA GROUP SA/NV	2,111	134.200	283,296.20	
ENAGAS SA	14,471	17.300	250,348.30	
ENDESA SA	14,104	17.545	247,454.68	
ENEL SPA	501,060	5.106	2,558,412.36	
ENGIE	117,899	14.360	1,693,029.64	
FORTUM OYJ	24,312	15.020	365,166.24	
IBERDROLA SA	376,863	10.655	4,015,475.26	
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,603	26.220	278,010.66	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	23,632	16.985	401,389.52	
RWE AG	38,604	41.740	1,611,330.96	
SNAM SPA	133,867	4.797	642,159.99	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA	101,686	7.198	731,935.82	
UNIPER SE	4,697	4.788	22,489.23	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	42,162	24.320	1,025,379.84	
VERBUND AG	5,346	85.700	458,152.20	
BOLLORE SE	69,288	5.235	362,722.68	
PUBLICIS GROUPE	13,301	63.000	837,963.00	
SCOUT24 SE	4,671	51.100	238,688.10	
UBISOFT ENTERTAINMENT	4,745	26.200	124,319.00	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	44,422	22.250	988,389.50	
VIVENDI SE	38,496	8.550	329,140.80	
ユーロ小計	11,705,778		278,558,159.68 (39,995,380,567)	
合計	69,777,127		411,677,365,126 (411,677,365,126)	

(注) 金額欄の()内は、外貨建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	597銘柄	67.9%	73.0%
カナダ・ドル	株式	85銘柄	3.6%	3.8%
オーストラリア・ドル	株式	49銘柄	2.1%	2.2%
香港・ドル	株式	28銘柄	0.7%	0.8%
シンガポール・ドル	株式	14銘柄	0.3%	0.4%

ニュージーランド・ドル	株式	5銘柄	0.1%	0.1%
イギリス・ポンド	株式	80銘柄	4.4%	4.7%
イスラエル・シケル	株式	10銘柄	0.1%	0.2%
スイス・フラン	株式	42銘柄	2.9%	3.1%
デンマーク・クローネ	株式	17銘柄	0.8%	0.8%
ノルウェー・クローネ	株式	12銘柄	0.2%	0.2%
スウェーデン・クローナ	株式	46銘柄	1.0%	1.1%
ユーロ	株式	224銘柄	9.0%	9.7%

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9,773.00	1,490,577.96	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	20,093.00	653,223.43	
		AMERICAN TOWER CORP	28,877.00	6,272,661.94	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	22,502.00	477,267.42	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	9,096.00	1,553,505.84	
		BOSTON PROPERTIES INC	9,604.00	678,906.76	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,009.00	707,559.75	
		CROWN CASTLE INC	27,033.00	3,760,560.63	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	18,137.00	1,972,398.75	
		EQUINIX INC	5,902.00	3,960,005.92	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	11,186.00	731,899.98	
		EQUITY RESIDENTIAL	22,609.00	1,437,480.22	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,379.00	939,251.71	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	8,530.00	1,309,525.60	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	17,613.00	908,302.41	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	22,843.00	455,260.99	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	36,377.00	932,706.28	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	46,189.00	861,886.74	
		INVITATION HOMES INC	36,871.00	1,176,922.32	
		IRON MOUNTAIN INC	19,659.00	1,058,833.74	
		KIMCO REALTY CORP	35,169.00	799,039.68	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	31,858.00	413,516.84	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	7,866.00	1,273,662.72	
		PROLOGIS INC	59,103.00	6,726,512.43	
		PUBLIC STORAGE	10,308.00	2,995,504.80	
		REALTY INCOME CORP	36,686.00	2,285,537.80	
		REGENCY CENTERS CORP	9,608.00	632,398.56	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	7,141.00	2,103,381.55	
SIMON PROPERTY GROUP INC	20,565.00	2,415,564.90			
SUN COMMUNITIES INC	7,129.00	1,032,350.49			
UDR INC	20,610.00	839,857.50			
VENTAS INC	23,363.00	1,060,680.20			
VICI PROPERTIES INC	60,354.00	2,032,119.18			

	VORNADO REALTY TRUST	8,706.00	220,348.86	
	WELLTOWER INC	27,308.00	1,889,713.60	
	WEYERHAEUSER CO	47,220.00	1,499,707.20	
	WP CAREY INC	11,067.00	865,660.74	
	アメリカ・ドル小計	807,343.00	60,424,295.44 (8,391,121,908)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,170.00	353,761.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,441.00	158,270.07	
	カナダ・ドル小計	15,611.00	512,031.07 (52,309,094)	
オーストラリア・ドル	APA GROUP	75,718.00	850,313.14	
	DEXUS/AU	79,604.00	625,687.44	
	GOODMAN GROUP	106,251.00	1,985,831.19	
	GPT GROUP	121,221.00	529,735.77	
	LENLEASE GROUP	36,263.00	276,324.06	
	MIRVAC GROUP	251,619.00	558,594.18	
	SCENTRE GROUP	350,311.00	1,029,914.34	
	STOCKLAND	127,393.00	484,093.40	
	TRANSURBAN GROUP	190,071.00	2,697,107.49	
	VICINITY CENTRES	241,241.00	489,719.23	
	オーストラリア・ドル小計	1,579,692.00	9,527,320.24 (884,040,045)	
香港・ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	193,500.00	1,075,860.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	276,000.00	2,586,120.00	
	LINK REIT	136,600.00	7,185,160.00	
	香港・ドル小計	606,100.00	10,847,140.00 (192,862,149)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	219,000.00	604,440.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	303,516.00	631,313.28	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	208,100.00	335,041.00	
	MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	112,400.00	194,452.00	
	シンガポール・ドル小計	843,016.00	1,765,246.28 (178,360,484)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	49,008.00	198,335.37	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	39,861.00	247,377.36	
	SEGRO PLC	78,831.00	637,269.80	
	イギリス・ポンド小計	167,700.00	1,082,982.53 (180,024,186)	
ユーロ	COVIVIO	2,388.00	134,563.80	
	GECINA SA	3,082.00	292,019.50	
	KLEPIERRE	13,600.00	303,008.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	7,024.00	365,107.52	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	9,913.00	254,962.36	
	ユーロ小計	36,007.00	1,349,661.18 (193,784,352)	

投資証券合計		10,072,502,218	
		(10,072,502,218)	
合計		10,072,502,218	
		(10,072,502,218)	

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

通貨	銘柄数	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 37銘柄	1.9%	83.3%
カナダ・ドル	投資証券 2銘柄	0.0%	0.5%
オーストラリア・ドル	投資証券 10銘柄	0.2%	8.8%
香港・ドル	投資証券 3銘柄	0.0%	1.9%
シンガポール・ドル	投資証券 4銘柄	0.0%	1.8%
イギリス・ポンド	投資証券 3銘柄	0.0%	1.8%
ユーロ	投資証券 5銘柄	0.0%	1.9%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2021年11月30日現在)	(2022年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	526,830,782	3,890,895,302
金銭信託	148,804,249	31,231,738
コール・ローン	4,388,726,863	192,702,578
株式	9,917,488,534	18,551,125,070
新株予約権証券	15,618	-
投資信託受益証券	609,236,472	1,080,935,590
投資証券	1,160,702,755	1,751,546,641
派生商品評価勘定	95,588,547	150,967,660
未収入金	81,341	-
未収配当金	6,023,917	34,213,350
差入委託証拠金	1,095,136,406	977,033,005
流動資産合計	17,948,635,484	26,660,650,934
資産合計	17,948,635,484	26,660,650,934
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	399,979,043	83,196,904
未払解約金	-	26,843,066
その他未払費用	19,220	543
流動負債合計	399,998,263	110,040,513

負債合計	399,998,263	110,040,513
純資産の部		
元本等		
元本	10,481,267,749	16,108,126,428
剰余金		
剰余金又は欠損金()	7,067,369,472	10,442,483,993
元本等合計	17,548,637,221	26,550,610,421
純資産合計	17,548,637,221	26,550,610,421
負債純資産合計	17,948,635,484	26,660,650,934

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年11月30日現在)	(2022年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における 受益権の総数	10,481,267,749口	16,108,126,428口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.6743円 (1万口当たりの純資産額16,743円)	1口当たり純資産額 1.6483円 (1万口当たりの純資産額16,483円)

(金融商品に関する注記)

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券、投資信託受益証券、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項 目	(2022年11月30日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券（株式、投資信託受益証券、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

		契 約 額 等		
--	--	---------	--	--

区 分	種 類		時 価		評 価 損 益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MSCIE 2112	6,380,573,149	-	5,988,815,825	391,757,324
	小計	6,380,573,149	-	5,988,815,825	391,757,324
合 計		6,380,573,149	-	5,988,815,825	391,757,324

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち 1年超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	7,983,376,975	-	8,071,411,706	88,034,731
	小計	7,983,376,975	-	8,071,411,706	88,034,731
	売建				
	アメリカ・ドル	3,329,000,000	-	3,329,667,903	667,903
	小計	3,329,000,000	-	3,329,667,903	667,903
合 計		11,312,376,975	-	11,401,079,609	87,366,828

(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MSCI EMGMKT DEC22	5,203,165,884	-	5,271,112,198	67,946,314
	小計	5,203,165,884	-	5,271,112,198	67,946,314
合 計		5,203,165,884	-	5,271,112,198	67,946,314

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち 1年超		
市場取引以外	為替予約取引 買建				

の取引	アメリカ・ドル	262,300,000	-	262,124,442	175,558
	小計	262,300,000	-	262,124,442	175,558
	合 計	262,300,000	-	262,124,442	175,558

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

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

(その他の注記)

(2021年11月30日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	8,871,955,436円
同期中における追加設定元本額	1,737,420,987円
同期中における一部解約元本額	128,108,674円
2021年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	5,579,019,461円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	2,537,014,239円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	281,123,454円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	347,001,173円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	231,807,511円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	25,823,557円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	75,281,661円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	55,223,465円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	223,853,475円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	174,716,658円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	286,040,332円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	64,850,516円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	3,488,528円

日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	188,448,982円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	358,795,181円
三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド	1,807,891円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	46,971,665円
合計	10,481,267,749円

(2022年11月30日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	10,481,267,749円
同期中における追加設定元本額	7,656,711,181円
同期中における一部解約元本額	2,029,852,502円
2022年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	8,414,992,973円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	2,960,029,922円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	183,852,090円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	291,047,771円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	194,328,149円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	40,006,969円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	100,172,461円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	75,036,325円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	334,887,158円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	274,169,234円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	448,887,023円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	103,796,383円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	5,268,543円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	706,099,778円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	1,907,693,075円
三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド	13,672,741円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	54,185,833円
合計	16,108,126,428円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	26,200	1.500	39,300.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	4,068	8.010	32,584.68	
	SOUTHERN COPPER CORP	2,096	59.330	124,355.68	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	10,416	24.050	250,504.80	
	LI AUTO INC - ADR	13,478	18.530	249,747.34	
	NIO INC - ADR	33,895	10.500	355,897.50	
	XPENG INC - ADR	10,439	7.340	76,622.26	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	4,760	36.060	171,645.60	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	11,121	5.770	64,168.17	

	TRIP.COM GROUP LTD-ADR	13,447	29.200	392,652.40	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	10,389	53.430	555,084.27	
	PINDUODUO INC-ADR	12,466	78.430	977,708.38	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	10,692	10.090	107,882.28	
	RLX TECHNOLOGY INC-ADR	10,343	2.180	22,547.74	
	BEIGENE LTD-ADR	1,163	179.860	209,177.18	
	HUTCHMED CHINA-ADR	1,444	12.970	18,728.68	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	1,201	48.510	58,260.51	
	ZAI LAB LTD-ADR	2,172	33.690	73,174.68	
	CREDICORP LTD	1,764	146.930	259,184.52	
	360 DIGITECH INC	2,669	14.560	38,860.64	
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	18,837	1.610	30,327.57	
	KE HOLDINGS INC-ADR	16,424	15.110	248,166.64	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	27,780	0.808	22,446.24	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	12,430	3.072	38,184.96	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	1,469	50.760	74,566.44	
	AUTOHOME INC-ADR	2,090	28.140	58,812.60	
	IQIYI INC-ADR	7,166	2.700	19,348.20	
	JOYY INC-ADR	1,164	29.910	34,815.24	
	KANZHUN LTD - ADR	4,491	16.470	73,966.77	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	19,174	6.600	126,548.40	
	WEIBO CORP-SPON ADR	1,472	14.740	21,697.28	
	アメリカ・ドル小計	296,720		4,826,967.65 (670,320,998)	
香港・ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	51,000	6.960	354,960.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	38,000	9.710	368,980.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	646,000	3.580	2,312,680.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	83,500	23.100	1,928,850.00	
	CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	29,000	3.360	97,440.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	520,000	3.480	1,809,600.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	38,000	24.650	936,700.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	72,000	3.220	231,840.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	32,500	28.000	910,000.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	47,000	7.080	332,760.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	104,000	6.790	706,160.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	52,000	4.170	216,840.00	
	CMOC GROUP LTD-H	66,000	3.530	232,980.00	
	DONGYUE GROUP	43,000	8.360	359,480.00	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO L-H	8,400	63.700	535,080.00	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	20,000	11.040	220,800.00	
	MMG LTD	80,000	2.030	162,400.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	37,000	5.850	216,450.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	14,250	14.740	210,045.00		
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	33,000	8.490	280,170.00		

ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	142,000	10.000	1,420,000.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	51,000	3.550	181,050.00	
BOC AVIATION LTD	6,100	58.350	355,935.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	54,000	2.610	140,940.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	44,500	17.380	773,410.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	23,000	9.230	212,290.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	104,000	4.310	448,240.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	42,000	9.020	378,840.00	
CITIC LTD	143,000	7.790	1,113,970.00	
CRRC CORP LTD - H	85,000	3.100	263,500.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	72,000	5.810	418,320.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	13,000	18.840	244,920.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	19,000	8.090	153,710.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	10,000	9.700	97,000.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	46,000	9.830	452,180.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	16,218	8.390	136,069.02	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	13,500	35.050	473,175.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	29,800	3.750	111,750.00	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	77,000	3.350	257,950.00	
AIR CHINA LTD-H	56,000	5.950	333,200.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	44,000	4.700	206,800.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	38,140	11.200	427,168.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	40,000	4.400	176,000.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	78,400	7.960	624,064.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	38,000	5.880	223,440.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	22,000	6.370	140,140.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	3,000	138.400	415,200.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	27,000	7.050	190,350.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	32,000	5.770	184,640.00	
BYD CO LTD-H	20,500	182.000	3,731,000.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	70,000	4.150	290,500.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	16,800	33.350	560,280.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	148,000	10.260	1,518,480.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	81,500	10.340	842,710.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	81,200	5.300	430,360.00	
MINTH GROUP LTD	22,000	19.800	435,600.00	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	34,000	13.600	462,400.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	30,800	87.650	2,699,620.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	72,000	3.570	257,040.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	56,600	25.400	1,437,640.00	
LI NING CO LTD	58,000	57.900	3,358,200.00	
SHENZHO INTERNATIONAL GROUP	20,400	66.900	1,364,760.00	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	33,000	8.490	280,170.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	31,000	16.560	513,360.00	

JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	16,000	17.460	279,360.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	37,500	20.750	778,125.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	25,600	15.360	393,216.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	374,600	78.750	29,499,750.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	100,000	6.100	610,000.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	12,000	14.280	171,360.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	27,500	66.000	1,815,000.00	
JD.COM INC - CL A	53,435	210.800	11,264,098.00	
MEITUAN-CLASS B	108,900	155.400	16,923,060.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	13,500	18.580	250,830.00	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	11,800	15.360	181,248.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	49,000	4.660	228,340.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	16,500	37.650	621,225.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	2,700	111.390	300,753.00	
CHINA FEIHE LTD	98,000	5.750	563,500.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	80,000	33.050	2,644,000.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	42,000	51.550	2,165,100.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	51,000	3.360	171,360.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	44,800	43.600	1,953,280.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	44,000	11.440	503,360.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	48,000	12.400	595,200.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	16,000	70.400	1,126,400.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	28,000	6.700	187,600.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	129,000	5.170	666,930.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	9,000	21.050	189,450.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	15,000	34.400	516,000.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	9,000	19.440	174,960.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	8,400	47.700	400,680.00	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	49,500	6.240	308,880.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	15,700	18.120	284,484.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	67,200	11.140	748,608.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	16,600	12.900	214,140.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	33,200	17.860	592,952.00	
3SBIO INC	30,500	8.110	247,355.00	
CANSINO BIOLOGICS INC-H	2,600	103.500	269,100.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	27,000	10.300	278,100.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	86,000	3.750	322,500.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	228,800	9.790	2,239,952.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	30,000	19.140	574,200.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	2,500	72.000	180,000.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	34,000	14.500	493,000.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	23,000	30.050	691,150.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	5,100	43.500	221,850.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	10,500	25.500	267,750.00	

SINO BIOPHARMACEUTICAL	271,000	4.510	1,222,210.00
WUXI APPTTEC CO LTD-H	8,711	74.150	645,920.65
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	88,500	48.950	4,332,075.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	744,000	2.570	1,912,080.00
BANK OF CHINA LTD-H	1,981,000	2.760	5,467,560.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	216,000	4.440	959,040.00
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	220,000	3.420	752,400.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	2,379,000	4.720	11,228,880.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	77,000	2.350	180,950.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	98,000	38.300	3,753,400.00
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	131,100	2.630	344,793.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	1,406,000	3.880	5,455,280.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	196,000	4.690	919,240.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	188,000	0.980	184,240.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	86,500	3.780	326,970.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	32,000	14.260	456,320.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	48,000	15.180	728,640.00
FAR EAST HORIZON LTD	28,000	6.100	170,800.00
GF SECURITIES CO LTD-H	27,200	11.060	300,832.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	60,800	4.680	284,544.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	32,400	8.950	289,980.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	189,000	11.640	2,199,960.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	65,000	17.460	1,134,900.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	35,400	7.480	264,792.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	21,700	17.640	382,788.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	174,000	2.600	452,400.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	170,000	7.830	1,331,100.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	157,500	47.250	7,441,875.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	14,900	19.000	283,100.00
A-LIVING SMART CITY SERVICES	18,250	9.240	168,630.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	66,000	1.400	92,400.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	96,000	1.860	178,560.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	94,500	21.350	2,017,575.00
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	30,000	8.850	265,500.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	80,000	35.750	2,860,000.00
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	15,800	36.000	568,800.00
CHINA VANKE CO LTD-H	39,200	16.560	649,152.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	104,000	1.250	130,000.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	170,000	3.050	518,500.00
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	54,000	19.300	1,042,200.00
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	22,500	13.060	293,850.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	34,000	5.360	182,240.00
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	13,310	9.490	126,311.90
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	47,500	23.100	1,097,250.00

SEAZEN GROUP LTD	32,000	3.800	121,600.00	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	18,500	3.650	67,525.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	53,000	3.800	201,400.00	
WHARF HOLDINGS LTD	30,000	22.350	670,500.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	29,600	9.800	290,080.00	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	66,000	6.250	412,500.00	
GDS HOLDINGS LTD-CL A	23,900	12.980	310,222.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	68,000	12.720	864,960.00	
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	12,000	6.070	72,840.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	21,000	14.260	299,460.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	13,500	17.880	241,380.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	13,000	24.550	319,150.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	13,500	24.000	324,000.00	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	21,000	7.700	161,700.00	
LENOVO GROUP LTD	178,000	6.440	1,146,320.00	
SUNNY OPTICAL TECH	18,200	90.050	1,638,910.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	377,000	9.970	3,758,690.00	
ZTE CORP-H	16,600	16.360	271,576.00	
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	9,000	19.220	172,980.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	14,000	26.600	372,400.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	120,000	8.890	1,066,800.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	1,108,000	0.820	908,560.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	10,500	23.900	250,950.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	100,000	1.940	194,000.00	
CGN POWER CO LTD-H	229,000	1.850	423,650.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	79,600	9.250	736,300.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	87,000	9.310	809,970.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	148,000	2.920	432,160.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	24,900	26.550	661,095.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	52,000	14.380	747,760.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	20,000	105.700	2,114,000.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	62,000	7.080	438,960.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	114,000	3.700	421,800.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	106,000	5.730	607,380.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	260,000	0.435	113,100.00	
BAIDU INC-CLASS A	54,350	98.150	5,334,452.50	
BILIBILI INC-CLASS Z	4,880	108.600	529,968.00	
CHINA LITERATURE LTD	12,200	27.000	329,400.00	
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	96,000	1.600	153,600.00	
KINGSOFT CORP LTD	20,200	23.600	476,720.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	43,100	54.800	2,361,880.00	
NETEASE INC	51,100	109.700	5,605,670.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	154,200	285.800	44,070,360.00	
香港・ドル小計	20,310,144		268,373,559.07	

				(4,771,681,880)	
台湾・ド ル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	24,000	84.500	2,028,000.00	
	ASIA CEMENT CORP	57,000	41.050	2,339,850.00	
	CHINA STEEL CORP	299,000	28.700	8,581,300.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	87,000	74.000	6,438,000.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	105,000	88.900	9,334,500.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	121,000	76.700	9,280,700.00	
	TAIWAN CEMENT	149,676	33.550	5,021,629.80	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	3,000	909.000	2,727,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	79,000	32.150	2,539,850.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	2,000	1,600.000	3,200,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	55,000	45.450	2,499,750.00	
	CHINA AIRLINES LTD	63,000	18.150	1,143,450.00	
	EVA AIRWAYS CORP	59,000	28.300	1,669,700.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	25,096	161.000	4,040,456.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	41,000	28.400	1,164,400.00	
	WAN HAI LINES LTD	14,605	74.700	1,090,993.50	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	43,000	65.100	2,799,300.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	44,000	34.550	1,520,200.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	4,000	450.000	1,800,000.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	10,640	190.000	2,021,600.00	
	GIANT MANUFACTURING	7,000	231.000	1,617,000.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	4,000	291.500	1,166,000.00	
	POU CHEN	54,000	32.300	1,744,200.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	7,000	639.000	4,473,000.00	
	MOMO.COM INC	1,200	602.000	722,400.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	13,000	268.500	3,490,500.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	119,000	65.800	7,830,200.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	99,741	17.250	1,720,532.25	
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	443,000	22.850	10,122,550.00	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	324,669	24.500	7,954,390.50	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	261,147	26.200	6,842,051.40	
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	218,970	22.350	4,893,979.50	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	281,700	31.500	8,873,550.00	
	SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	252,737	17.750	4,486,081.75	
	TAISHIN FINANCIAL HOLDING	265,647	15.000	3,984,705.00	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	242,108	26.500	6,415,862.00	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	88,299	47.800	4,220,692.20		
CHAILEASE HOLDING CO LTD	33,836	192.500	6,513,430.00		
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	246,284	22.500	5,541,390.00		
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	200,000	43.450	8,690,000.00		
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	381,196	13.200	5,031,787.20		
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	187,950	59.600	11,201,820.00		
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	323,432	8.850	2,862,373.20		

RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	36,270	45.900	1,664,793.00	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	12,000	268.000	3,216,000.00	
ACER INC	61,000	24.600	1,500,600.00	
ADVANTECH CO LTD	11,299	319.500	3,610,030.50	
ASUSTEK COMPUTER INC	17,000	267.000	4,539,000.00	
AUO CORP	161,600	16.150	2,609,840.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	18,000	181.000	3,258,000.00	
COMPAL ELECTRONICS	88,000	21.500	1,892,000.00	
DELTA ELECTRONICS INC	48,000	298.000	14,304,000.00	
E INK HOLDINGS INC	22,000	177.000	3,894,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	307,800	100.000	30,780,000.00	
INNOLUX CORP	242,540	12.350	2,995,369.00	
INVENTEC CORP	72,000	24.700	1,778,400.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	2,480	2,270.000	5,629,600.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	49,000	65.600	3,214,400.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	14,000	122.000	1,708,000.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	6,000	267.000	1,602,000.00	
PEGATRON CORP	53,000	61.500	3,259,500.00	
QUANTA COMPUTER INC	70,000	71.500	5,005,000.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	28,000	57.600	1,612,800.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	31,000	151.000	4,681,000.00	
WIWYNN CORP	2,000	868.000	1,736,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	33,520	47.250	1,583,820.00	
YAGEO CORPORATION	8,912	438.000	3,903,456.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	14,000	119.000	1,666,000.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	83,000	95.400	7,918,200.00	
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	500	739.000	369,500.00	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	2,000	1,455.000	2,910,000.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	5,000	465.000	2,325,000.00	
MEDIATEK INC	37,000	713.000	26,381,000.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	26,000	57.200	1,487,200.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	14,000	293.000	4,102,000.00	
PARADE TECHNOLOGIES LTD	2,000	782.000	1,564,000.00	
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	80,000	32.600	2,608,000.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	11,000	314.500	3,459,500.00	
SILERGY CORP	8,800	467.000	4,109,600.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	608,000	487.000	296,096,000.00	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	292,000	44.650	13,037,800.00	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	19,000	83.300	1,582,700.00	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	6,000	155.000	930,000.00	
WINBOND ELECTRONICS CORP	61,000	21.250	1,296,250.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	96,000	112.000	10,752,000.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	36,000	66.700	2,401,200.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	43,000	94.000	4,042,000.00	

台湾・ドル小計		8,181,654		690,654,732.80 (3,101,177,881)	
エジプト・ポンド	EASTERN CO SAE	13,558	13.900	188,456.20	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BAN	55,939	39.840	2,228,609.76	
	EFG-HERMES HOLDING SAE	15,925	14.270	227,249.75	
エジプト・ポンド小計		85,422		2,644,315.71 (14,940,119)	
トルコ・リラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	2,650	485.000	1,285,250.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	38,881	41.860	1,627,558.66	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	19,291	46.760	902,047.16	
	KOC HOLDING AS	15,538	70.800	1,100,090.40	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	39,792	38.780	1,543,133.76	
	TURK HAVA YOLLARI AO	13,066	120.500	1,574,453.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	1,688	442.800	747,446.40	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	12,175	134.400	1,636,320.00	
	AKBANK T.A.S.	70,766	17.660	1,249,727.56	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	27,103	40.580	1,099,839.74	
	TURKIYE IS BANKASI-C	86,259	10.290	887,605.11	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	27,080	34.200	926,136.00	
トルコ・リラ小計		354,289		14,579,607.79 (108,613,704)	
メキシコ・ペソ	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	77,000	72.190	5,558,630.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	3,095	257.700	797,581.50	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	20,300	37.020	751,506.00	
	ALFA S.A.B.-A	83,900	13.250	1,111,675.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	11,100	82.640	917,304.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	8,900	299.580	2,666,262.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	4,780	457.900	2,188,762.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	5,105	167.840	856,823.20	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	131,500	72.380	9,517,970.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	10,900	160.880	1,753,592.00	
	GRUMA S.A.B.-B	5,050	231.610	1,169,630.50	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	32,900	81.680	2,687,272.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	31,900	32.670	1,042,173.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	65,300	149.640	9,771,492.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	53,100	35.660	1,893,546.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	697,100	18.640	12,993,944.00	
	OPERADORA DE SITES MEX- A-1	30,400	21.560	655,424.00	
SITIOS LATINOAMERICA SAB DE	34,855	8.180	285,113.90		
メキシコ・ペソ小計		1,307,185		56,618,701.10 (408,911,583)	
フィリピン・ペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	42,090	60.000	2,525,400.00	
	AYALA CORPORATION	6,750	696.000	4,698,000.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	1,310	439.000	575,090.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	82,562	49.100	4,053,794.20	

	SM INVESTMENTS CORP	5,405	939.000	5,075,295.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	23,130	205.000	4,741,650.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	12,830	245.000	3,143,350.00	
	MONDE NISSIN CORP	155,700	12.640	1,968,048.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	17,230	133.000	2,291,590.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	49,227	105.900	5,213,139.30	
	BDO UNIBANK INC	52,070	130.100	6,774,307.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	38,980	57.300	2,233,554.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	110,900	3.460	383,714.00	
	AYALA LAND INC	198,000	31.500	6,237,000.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	284,800	36.400	10,366,720.00	
	CONVERGE INFORMATION AND COM	47,400	15.460	732,804.00	
	GLOBE TELECOM INC	620	2,300.000	1,426,000.00	
	PLDT INC	2,005	1,752.000	3,512,760.00	
	ACEN CORP	141,680	7.110	1,007,344.80	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	5,120	280.000	1,433,600.00	
	フィリピン・ペソ小計	1,277,809		68,393,160.30 (167,795,778)	
チリ・ペソ	EMPRESAS COPEC SA	10,529	6,035.000	63,542,515.00	
	EMPRESAS CMPC SA	22,543	1,473.900	33,226,127.70	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	3,601	86,250.000	310,586,250.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	374,056	70.000	26,183,920.00	
	FALABELLA SA	15,911	1,555.000	24,741,605.00	
	CENCOSUD SA	40,071	1,310.100	52,497,017.10	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	1,586	5,500.000	8,723,000.00	
	BANCO DE CHILE	1,024,325	83.650	85,684,786.25	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	1,084	24,510.000	26,568,840.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	1,825,075	34.250	62,508,818.75	
	ENEL AMERICAS SA	600,505	119.000	71,460,095.00	
ENEL CHILE SA	364,877	40.500	14,777,518.50		
	チリ・ペソ小計	4,284,163		780,500,493.30 (119,894,242)	
コロンビア・ペソ	ECOPETROL SA	134,524	2,475.000	332,946,900.00	
	BANCOLOMBIA SA	5,994	40,700.000	243,955,800.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	12,217	30,990.000	378,604,830.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	8,110	19,080.000	154,738,800.00	
	コロンビア・ペソ小計	160,845		1,110,246,330.00 (32,032,827)	
インド・ルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	21,390	339.050	7,252,279.50	
	COAL INDIA LTD	37,979	227.200	8,628,828.80	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	15,734	238.500	3,752,559.00	
	INDIAN OIL CORP LTD	66,526	75.300	5,009,407.80	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	62,021	140.250	8,698,445.25	
	PETRONET LNG LTD	18,486	211.850	3,916,259.10	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	75,244	2,712.200	204,076,776.80	

ACC LTD	1,628	2,514.050	4,092,873.40
AMBUJA CEMENTS LTD	16,248	564.950	9,179,307.60
ASIAN PAINTS LTD	9,511	3,135.050	29,817,460.55
BERGER PAINTS INDIA LTD	6,933	612.200	4,244,382.60
GRASIM INDUSTRIES LTD	6,476	1,719.150	11,133,215.40
HINDALCO INDUSTRIES LTD	34,596	435.950	15,082,126.20
JINDAL STEEL & POWER LTD	8,561	515.000	4,408,915.00
JSW STEEL LTD	18,789	732.550	13,763,881.95
PI INDUSTRIES LTD	1,869	3,375.000	6,307,875.00
PIDILITE INDUSTRIES LTD	3,991	2,727.950	10,887,248.45
SHREE CEMENT LTD	295	23,218.350	6,849,413.25
SRF LTD	3,336	2,320.950	7,742,689.20
TATA STEEL LTD	180,637	106.100	19,165,585.70
ULTRATECH CEMENT LTD	2,491	6,928.900	17,259,889.90
UPL LTD	12,873	774.850	9,974,644.05
VEDANTA LTD	15,567	301.850	4,698,898.95
ADANI ENTERPRISES LTD	7,025	3,878.400	27,245,760.00
BHARAT ELECTRONICS LTD	90,096	106.150	9,563,690.40
HAVELLS INDIA LTD	5,714	1,234.850	7,055,932.90
LARSEN & TOUBRO LTD	17,309	2,050.550	35,492,969.95
SIEMENS LTD	1,495	2,778.700	4,154,156.50
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	6,819	723.000	4,930,137.00
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	13,018	878.200	11,432,407.60
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	6,593	759.650	5,008,372.45
INTERGLOBE AVIATION LTD	2,035	1,911.350	3,889,597.25
BAJAJ AUTO LTD	1,601	3,660.100	5,859,820.10
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	1,906	2,035.000	3,878,710.00
BHARAT FORGE LTD	5,374	848.750	4,561,182.50
EICHER MOTORS LTD	3,370	3,416.100	11,512,257.00
HERO MOTOCORP LTD	2,709	2,828.250	7,661,729.25
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	21,636	1,257.100	27,198,615.60
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,979	8,910.200	26,543,485.80
MRF LTD	47	92,565.150	4,350,562.05
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	50,106	73.300	3,672,769.80
TATA MOTORS LTD	40,931	433.150	17,729,262.65
PAGE INDUSTRIES LTD	151	47,092.350	7,110,944.85
TITAN CO LTD	8,754	2,613.750	22,880,767.50
JUBILANT FOODWORKS LTD	9,393	546.050	5,129,047.65
TRENT LTD	4,308	1,456.950	6,276,540.60
ZOMATO LTD	58,211	63.550	3,699,309.05
AVENUE SUPERMARTS LTD	3,992	3,965.100	15,828,679.20
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	2,672	4,285.350	11,450,455.20
ITC LTD	72,909	342.300	24,956,750.70
MARICO LTD	13,955	502.400	7,010,992.00

NESTLE INDIA LTD	832	20,121.200	16,740,838.40	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	13,630	805.050	10,972,831.50	
UNITED SPIRITS LTD	7,165	907.450	6,501,879.25	
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	2,569	1,602.600	4,117,079.40	
DABUR INDIA LTD	16,354	593.100	9,699,557.40	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	10,773	865.650	9,325,647.45	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	20,515	2,634.200	54,040,613.00	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	2,481	4,719.200	11,708,335.20	
AUROBINDO PHARMA LTD	6,499	466.600	3,032,433.40	
BIOCON LTD	10,292	282.100	2,903,373.20	
CIPLA LTD	11,934	1,121.150	13,379,804.10	
DIVI'S LABORATORIES LTD	3,272	3,372.700	11,035,474.40	
DR. REDDY'S LABORATORIES	2,872	4,453.350	12,790,021.20	
LUPIN LTD	4,861	751.450	3,652,798.45	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	23,658	1,049.850	24,837,351.30	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	2,503	1,635.000	4,092,405.00	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	3,304	627.350	2,072,764.40	
AXIS BANK LTD	56,886	892.550	50,773,599.30	
BANDHAN BANK LTD	13,522	234.150	3,166,176.30	
ICICI BANK LTD	127,560	946.750	120,767,430.00	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	13,704	1,925.550	26,387,737.20	
STATE BANK OF INDIA	44,000	608.550	26,776,200.00	
YES BANK LTD	277,899	17.050	4,738,177.95	
BAJAJ FINANCE LTD	6,716	6,734.150	45,226,551.40	
BAJAJ FINSERV LTD	9,410	1,632.000	15,357,120.00	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	10,122	714.750	7,234,699.50	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	42,746	2,665.250	113,928,776.50	
MUTHOOT FINANCE LTD	2,968	1,087.050	3,226,364.40	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	4,949	817.300	4,044,817.70	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	4,668	1,270.300	5,929,760.40	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	23,440	584.850	13,708,884.00	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	5,930	1,175.700	6,971,901.00	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	7,542	471.100	3,553,036.20	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	11,098	1,258.400	13,965,723.20	
DLF LTD	15,255	392.550	5,988,350.25	
GODREJ PROPERTIES LTD	3,083	1,278.550	3,941,769.65	
HCL TECHNOLOGIES LTD	26,758	1,128.950	30,208,444.10	
INFOSYS LTD	83,406	1,629.050	135,872,544.30	
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	2,246	4,912.150	11,032,688.90	
MPHASIS LTD	1,773	2,003.650	3,552,471.45	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	22,550	3,397.350	76,610,242.50	
TATA ELXSI LTD	844	6,781.750	5,723,797.00	
TECH MAHINDRA LTD	14,379	1,074.550	15,450,954.45	
WIPRO LTD	33,678	405.150	13,644,641.70	

	BHARTI AIRTEL LTD	55,035	835.850	46,001,004.75	
	INDUS TOWERS LTD	16,890	199.450	3,368,710.50	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	7,809	2,012.050	15,712,098.45	
	ADANI POWER LTD	19,015	324.700	6,174,170.50	
	ADANI TOTAL GAS LTD	6,778	3,600.000	24,400,800.00	
	ADANI TRANSMISSION LTD	7,036	2,782.700	19,579,077.20	
	GAIL INDIA LTD	48,927	94.150	4,606,477.05	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	6,611	433.500	2,865,868.50	
	NTPC LTD	95,615	170.150	16,268,892.25	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	77,378	219.350	16,972,864.30	
	TATA POWER CO LTD	35,446	223.450	7,920,408.70	
	INFO EDGE INDIA LTD	1,749	3,961.150	6,928,051.35	
	インド・ルピー小計	2,465,224		1,881,512,358.95 (3,217,386,134)	
インドネ シア・ル ピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBK P	354,800	3,880.000	1,376,624,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	38,700	30,700.000	1,188,090,000.00	
	ADARO MINERALS INDONESIA TBK	171,600	1,640.000	281,424,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	128,000	1,965.000	251,520,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	626,800	810.000	507,708,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	57,500	9,750.000	560,625,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	325,161	4,110.000	1,336,411,710.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	91,200	7,600.000	693,120,000.00	
	VALE INDONESIA TBK	52,100	7,300.000	380,330,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	516,000	6,050.000	3,121,800,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	410,100	2,840.000	1,164,684,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	175,400	5,825.000	1,021,705,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	10,800	21,450.000	231,660,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	71,100	9,975.000	709,222,500.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	87,700	6,325.000	554,702,500.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	182,700	4,700.000	858,690,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	520,000	2,100.000	1,092,000,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,382,000	8,975.000	12,403,450,000.00	
	BANK JAGO TBK PT	102,500	4,690.000	480,725,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	460,200	10,325.000	4,751,565,000.00	
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	183,900	9,375.000	1,724,062,500.00		
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	1,709,100	4,850.000	8,289,135,000.00		
SARANA MENARA NUSANTARA PT	516,500	1,145.000	591,392,500.00		
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	1,229,700	3,980.000	4,894,206,000.00		
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	118,900	2,300.000	273,470,000.00		
	インドネシア・ルピア小計	9,522,461		48,738,322,710.00 (433,771,072)	
ブラジ ル・レア ル	COSAN SA	29,988	17.270	517,892.76	
	PETRO RIO SA	17,400	35.280	613,872.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	91,700	29.380	2,694,146.00	

PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	117,400	25.380	2,979,612.00	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	17,600	13.740	241,824.00	
BRASKEM SA-PREF A	4,000	29.200	116,800.00	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	14,600	14.350	209,510.00	
GERDAU SA-PREF	29,900	31.020	927,498.00	
SUZANO SA	19,315	53.310	1,029,682.65	
VALE SA	98,688	84.440	8,333,214.72	
WEG SA	41,360	37.710	1,559,685.60	
CCR SA	32,700	11.750	384,225.00	
LOCALIZA RENT A CAR	18,930	60.420	1,143,750.60	
RUMO SA	34,000	19.460	661,640.00	
AMERICANAS SA	13,024	10.240	133,365.76	
LOJAS RENNER S.A.	24,358	22.960	559,259.68	
MAGAZINE LUIZA SA	74,900	3.360	251,664.00	
VIBRA ENERGIA SA	28,680	16.360	469,204.80	
ATACADAO SA	14,200	15.740	223,508.00	
RAIA DROGASIL SA	24,200	22.470	543,774.00	
AMBEV SA	116,500	15.760	1,836,040.00	
BRF SA	15,000	10.010	150,150.00	
JBS SA	18,400	22.460	413,264.00	
NATURA &CO HOLDING SA	22,100	11.510	254,371.00	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	114,419	5.190	593,834.61	
REDE D'OR SAO LUIZ SA	9,900	30.230	299,277.00	
HYPERA SA	10,100	44.410	448,541.00	
BANCO BRADESCO S.A.	39,481	13.340	526,676.54	
BANCO BRADESCO SA-PREF	133,536	15.510	2,071,143.36	
BANCO DO BRASIL S.A.	21,200	35.250	747,300.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	121,000	25.740	3,114,540.00	
ITAUSA SA	125,805	8.790	1,105,825.95	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	153,600	12.550	1,927,680.00	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	17,300	30.890	534,397.00	
TOTVS SA	12,900	29.210	376,809.00	
TELEFONICA BRASIL S.A.	11,300	38.440	434,372.00	
TIM SA	18,200	13.120	238,784.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	26,805	46.520	1,246,968.60	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	5,700	49.040	279,528.00	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	34,299	11.410	391,351.59	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	9,300	59.840	556,512.00	
CPFL ENERGIA SA	4,800	34.120	163,776.00	
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	4,250	39.290	166,982.50	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	22,800	27.430	625,404.00	
ブラジル・リアル小計	1,815,638		42,097,657.72 (1,105,985,454)	
チェコ・	KOMERCNI BANKA AS	1,821	690.500	1,257,400.50

コロナ	MONETA MONEY BANK AS	4,790	71.800	343,922.00	
	CEZ AS	4,177	804.500	3,360,396.50	
チェコ・コロナ小計		10,788		4,961,719.00 (29,253,799)	
韓国・ ウォン	HD HYUNDAI	1,340	64,800.000	86,832,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	1,368	175,000.000	239,400,000.00	
	S-OIL CORP	1,213	86,800.000	105,288,400.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	2,623	52,200.000	136,920,600.00	
	HYUNDAI STEEL CO	1,821	33,550.000	61,094,550.00	
	KOREA ZINC CO LTD	227	633,000.000	143,691,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	531	150,500.000	79,915,500.00	
	LG CHEM LTD	1,232	715,000.000	880,880,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	227	331,000.000	75,137,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	360	185,000.000	66,600,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	641	222,500.000	142,622,500.00	
	POSCO HOLDINGS INC	1,934	293,500.000	567,629,000.00	
	SK CHEMICALS CO LTD	144	94,800.000	13,651,200.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	526	66,200.000	34,821,200.00	
	SKC CO LTD	496	109,500.000	54,312,000.00	
	CJ CORP	498	76,900.000	38,296,200.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	1,293	41,350.000	53,465,550.00	
	DOOSAN ENERBILITY CO LTD	10,618	16,600.000	176,258,800.00	
	ECOPRO BM CO LTD	1,290	110,500.000	142,545,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	1,373	23,750.000	32,608,750.00	
	GS HOLDINGS	1,178	46,550.000	54,835,900.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	1,849	40,600.000	75,069,400.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	448	114,000.000	51,072,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,568	47,700.000	74,793,600.00	
	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	1,158	76,700.000	88,818,600.00	
	LG CORP	2,459	84,700.000	208,277,300.00	
	LG ENERGY SOLUTION	600	567,000.000	340,200,000.00	
	SAMSUNG C&T CORP	2,163	121,000.000	261,723,000.00	
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	4,316	24,550.000	105,957,800.00	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	14,496	5,160.000	74,799,360.00	
	SK INC	961	215,500.000	207,095,500.00	
	S-1 CORPORATION	219	64,200.000	14,059,800.00	
	CJ LOGISTICS	235	92,500.000	21,737,500.00	
	HMM CO LTD	7,125	21,850.000	155,681,250.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	524	172,500.000	90,390,000.00		
KOREAN AIR LINES CO LTD	4,701	25,200.000	118,465,200.00		
PAN OCEAN CO LTD	4,527	5,350.000	24,219,450.00		
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	2,114	34,050.000	71,981,700.00		
HANON SYSTEMS	4,138	8,710.000	36,041,980.00		
HYUNDAI MOBIS CO LTD	1,515	208,500.000	315,877,500.00		

HYUNDAI MOTOR CO	3,424	169,000.000	578,656,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	863	80,300.000	69,298,900.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	582	79,800.000	46,443,600.00	
KIA CORP	6,495	67,300.000	437,113,500.00	
COWAY CO LTD	1,284	55,500.000	71,262,000.00	
F&F CO LTD / NEW	502	149,500.000	75,049,000.00	
LG ELECTRONICS INC	2,622	93,800.000	245,943,600.00	
KANGWON LAND INC	2,078	24,600.000	51,118,800.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	680	72,400.000	49,232,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	172	84,100.000	14,465,200.00	
BGF RETAIL CO LTD	193	199,000.000	38,407,000.00	
E-MART INC	516	91,900.000	47,420,400.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	174	389,500.000	67,773,000.00	
KT&G CORP	2,707	96,700.000	261,766,900.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	694	116,000.000	80,504,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	808	130,000.000	105,040,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	473	33,000.000	15,609,000.00	
LG H&H	231	654,000.000	151,074,000.00	
LG H&H-PRF	35	282,500.000	9,887,500.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	2,295	64,700.000	148,486,500.00	
HLB INC	2,599	32,500.000	84,467,500.00	
SD BIOSENSOR INC	604	32,950.000	19,901,800.00	
ALTEOGEN INC	882	37,850.000	33,383,700.00	
CELLTRION INC	2,486	176,500.000	438,779,000.00	
CELLTRION PHARM INC	347	66,400.000	23,040,800.00	
GREEN CROSS CORP	79	135,500.000	10,704,500.00	
HANMI PHARM CO LTD	171	256,500.000	43,861,500.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	452	885,000.000	400,020,000.00	
SEEGENE INC	713	33,200.000	23,671,600.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	657	73,000.000	47,961,000.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	550	80,700.000	44,385,000.00	
YUHAN CORP	1,226	57,400.000	70,372,400.00	
HANA FINANCIAL GROUP	7,294	43,750.000	319,112,500.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	5,467	11,050.000	60,410,350.00	
KAKAOBANK CORP	2,498	25,050.000	62,574,900.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	9,657	51,600.000	498,301,200.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	11,380	37,350.000	425,043,000.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	13,459	12,650.000	170,256,350.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	873	57,200.000	49,935,600.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	824	36,600.000	30,158,400.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	5,528	5,640.000	31,177,920.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	8,457	6,630.000	56,069,910.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	2,376	9,490.000	22,548,240.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	1,312	35,150.000	46,116,800.00	

	DB INSURANCE CO LTD	912	61,300.000	55,905,600.00	
	MERITZ FIRE & MARINE INSURAN	969	43,700.000	42,345,300.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	759	204,500.000	155,215,500.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	2,148	70,700.000	151,863,600.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	942	124,000.000	116,808,000.00	
	ILJIN MATERIALS CO LTD	385	61,100.000	23,523,500.00	
	L&F CO LTD	576	217,000.000	124,992,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	4,881	14,500.000	70,774,500.00	
	LG INNOTEK CO LTD	382	299,000.000	114,218,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1,381	134,500.000	185,744,500.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	117,729	60,600.000	7,134,377,400.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	20,285	55,000.000	1,115,675,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	1,371	718,000.000	984,378,000.00	
	SK HYNIX INC	13,459	83,700.000	1,126,518,300.00	
	SK SQUARE CO LTD	2,713	36,650.000	99,431,450.00	
	LG UPLUS CORP	4,555	11,950.000	54,432,250.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	5,778	20,250.000	117,004,500.00	
	CHEIL WORLDWIDE INC	1,193	24,000.000	28,632,000.00	
	CJ ENM CO LTD	144	89,400.000	12,873,600.00	
	HYBE CO LTD	459	144,000.000	66,096,000.00	
	KAKAO CORP	7,811	55,900.000	436,634,900.00	
	KAKAO GAMES CORP	734	42,550.000	31,231,700.00	
	KRAFTON INC	650	219,000.000	142,350,000.00	
	NAVER CORP	3,280	182,500.000	598,600,000.00	
	NCSOFT CORP	406	454,500.000	184,527,000.00	
	NETMARBLE CORP	337	49,200.000	16,580,400.00	
	PEARL ABYSS CORP	498	43,800.000	21,812,400.00	
	韓国・ウォン小計	387,505		24,312,416,360.00 (2,547,941,235)	
マレーシ ア・リン ギット	DIALOG GROUP BHD	90,500	2.230	201,815.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	7,300	22.400	163,520.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	63,200	8.520	538,464.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	82,100	4.800	394,080.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	20,400	6.870	140,148.00	
	SIME DARBY BERHAD	47,100	2.200	103,620.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	14,700	6.270	92,169.00	
	MISC BHD	28,500	7.200	205,200.00	
	GENTING BHD	60,200	4.430	266,686.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	73,100	2.660	194,446.00	
	MR DIY GROUP M BHD	63,450	2.000	126,900.00	
	IOI CORP BHD	70,600	3.880	273,928.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	8,600	21.140	181,804.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	1,500	130.400	195,600.00	
	PPB GROUP BERHAD	13,340	16.220	216,374.80	

	QL RESOURCES BHD	29,250	5.530	161,752.50	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	59,300	4.350	257,955.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	37,700	1.760	66,352.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	41,700	5.950	248,115.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	97,900	0.875	85,662.50	
	AMMB HOLDINGS BHD	39,300	4.120	161,916.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	172,800	5.820	1,005,696.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	16,000	20.880	334,080.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	5,700	19.000	108,300.00	
	MALAYAN BANKING BHD	122,000	8.700	1,061,400.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	366,600	4.410	1,616,706.00	
	RHB BANK BHD	28,900	5.670	163,863.00	
	INARI AMERTRON BHD	52,900	2.710	143,359.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	52,900	3.090	163,461.00	
	DIGI.COM BHD	86,400	3.880	335,232.00	
	MAXIS BHD	57,900	3.910	226,389.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	34,000	5.580	189,720.00	
	PETRONAS GAS BHD	21,600	16.720	361,152.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	67,600	9.020	609,752.00	
	マレーシア・リングット小計	2,035,040		10,595,617.80 (326,235,893)	
南アフリ カ・ラン ド	EXXARO RESOURCES LTD	6,027	224.170	1,351,072.59	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	2,473	280.420	693,478.66	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	1,308	1,620.640	2,119,797.12	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	10,879	302.200	3,287,633.80	
	GOLD FIELDS LTD	22,932	184.590	4,233,017.88	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	11,645	59.760	695,905.20	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	20,959	201.450	4,222,190.55	
	KUMBA IRON ORE LTD	1,588	469.670	745,835.96	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	8,310	188.000	1,562,280.00	
	SASOL LTD	13,960	292.730	4,086,510.80	
	SIBANYE STILLWATER LTD	73,151	45.160	3,303,499.16	
	BIDVEST GROUP LTD	7,735	223.990	1,732,562.65	
	MR PRICE GROUP LTD	6,331	166.620	1,054,871.22	
	NASPERS LTD-N SHS	5,394	2,484.510	13,401,446.94	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	35,012	21.430	750,307.16	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	6,946	104.270	724,259.42	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	24,638	65.700	1,618,716.60	
	BID CORP LTD	8,268	328.260	2,714,053.68	
	CLICKS GROUP LTD	6,014	289.270	1,739,669.78	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	12,962	250.160	3,242,573.92	
SPAR GROUP LIMITED/THE	4,180	137.000	572,660.00		
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	9,393	142.750	1,340,850.75		
ABSA GROUP LTD	19,853	202.180	4,013,879.54		

	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	2,146	1,982.500	4,254,445.00	
	NEDBANK GROUP LTD	11,348	225.010	2,553,413.48	
	STANDARD BANK GROUP LTD	33,094	177.970	5,889,739.18	
	FIRSTRAND LTD	124,451	65.040	8,094,293.04	
	REINET INVESTMENTS SCA	2,879	304.350	876,223.65	
	REMGRO LTD	13,046	142.200	1,855,141.20	
	DISCOVERY LTD	12,309	123.920	1,525,331.28	
	OLD MUTUAL LTD	116,070	10.940	1,269,805.80	
	SANLAM LTD	43,917	54.910	2,411,482.47	
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	11,259	101.410	1,141,775.19	
	MTN GROUP LTD	42,837	135.950	5,823,690.15	
	VODACOM GROUP LTD	16,889	127.100	2,146,591.90	
	MULTICHOICE GROUP LTD	7,894	119.000	939,386.00	
	南アフリカ・ランド小計	758,097		97,988,391.72 (799,585,275)	
タイ・ パーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	34,300	188.500	6,465,550.00	
	PTT PCL-NVDR	252,400	33.250	8,392,300.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	24,800	55.500	1,376,400.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	35,700	41.750	1,490,475.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	61,700	48.250	2,977,025.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	27,300	55.750	1,521,975.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	19,200	340.000	6,528,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	105,600	74.500	7,867,200.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR	221,600	9.300	2,060,880.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	229,500	8.250	1,893,375.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	184,500	6.200	1,143,900.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	72,700	30.250	2,199,175.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	36,791	42.500	1,563,617.50	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	166,900	14.500	2,420,050.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	72,100	24.400	1,759,240.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	19,000	33.500	636,500.00	
	CP ALL PCL-NVDR	148,700	63.500	9,442,450.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	5,400	94.500	510,300.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	106,800	23.700	2,531,160.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	38,500	28.000	1,078,000.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	58,800	17.200	1,011,360.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	254,600	29.750	7,574,350.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	14,700	219.000	3,219,300.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	16,500	145.500	2,400,750.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	103,500	17.600	1,821,600.00	
SCB X PCL-NVDR	23,400	105.000	2,457,000.00		
BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	43,300	15.500	671,150.00		
JMT NETWORK SERVICES-NVDR	16,600	66.000	1,095,600.00		
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	27,100	58.750	1,592,125.00		

	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	16,200	37.000	599,400.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	11,800	45.250	533,950.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	46,300	69.500	3,217,850.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	176,900	9.450	1,671,705.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	7,700	656.000	5,051,200.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	29,300	190.000	5,567,000.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	27,000	73.750	1,991,250.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	259,200	4.540	1,176,768.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	20,900	37.000	773,300.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	5,500	172.000	946,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	44,900	94.750	4,254,275.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	14,800	69.500	1,028,600.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	78,100	52.000	4,061,200.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	19,600	41.000	803,600.00	
	タイ・パーツ小計	3,180,191		117,376,905.50 (461,291,239)	
ポーランド・ズロチ	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	13,722	64.800	889,185.60	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	3,845	115.400	443,713.00	
	LPP SA	23	9,435.000	217,005.00	
	ALLEGRO.EU SA	10,674	23.100	246,569.40	
	DINO POLSKA SA	1,310	370.000	484,700.00	
	BANK PEKAO SA	3,856	83.880	323,441.28	
	MBANK SA	302	316.000	95,432.00	
	PKO BANK POLSKI SA	23,204	28.350	657,833.40	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	751	268.400	201,568.40	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	16,272	31.800	517,449.60	
	ORANGE POLSKA SA	15,737	6.922	108,931.51	
	PGE SA	19,508	6.380	124,461.04	
	CD PROJEKT SA	1,469	131.480	193,144.12	
	CYFROWY POLSAT SA	5,742	18.680	107,260.56	
	ポーランド・ズロチ小計	116,415		4,610,694.91 (141,603,201)	
ハンガリー・フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	8,186	2,790.000	22,838,940.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	2,331	8,420.000	19,627,020.00	
	OTP BANK PLC	4,109	10,700.000	43,966,300.00	
	ハンガリー・フォリント小計	14,626		86,432,260.00 (30,561,583)	
ユーロ	MYTILINEOS S.A.	2,326	17.890	41,612.14	
	FF GROUP	123	4.800	590.40	
	OPAP SA	4,784	13.160	62,957.44	
	JUMBO SA	2,851	14.970	42,679.47	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	53,592	1.030	55,199.76	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	64,000	1.077	68,928.00	
	NATIONAL BANK OF GREECE	13,389	3.760	50,342.64	

	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	5,406	14.780	79,900.68	
	PUBLIC POWER CORP	4,579	6.680	30,587.72	
	ユーロ小計	151,050		432,798.25 (62,141,173)	
	合計	56,715,266		18,551,125,070 (18,551,125,070)	

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

通貨	銘柄数		組入株式時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	株式	31銘柄	2.5%	3.6%
香港・ドル	株式	195銘柄	18.0%	25.7%
台湾・ドル	株式	87銘柄	11.7%	16.7%
エジプト・ポンド	株式	3銘柄	0.1%	0.1%
トルコ・リラ	株式	12銘柄	0.4%	0.6%
メキシコ・ペソ	株式	18銘柄	1.5%	2.2%
フィリピン・ペソ	株式	20銘柄	0.6%	0.9%
チリ・ペソ	株式	12銘柄	0.5%	0.6%
コロンビア・ペソ	株式	4銘柄	0.1%	0.2%
インド・ルピー	株式	107銘柄	12.1%	17.3%
インドネシア・ルピア	株式	25銘柄	1.6%	2.3%
ブラジル・レアル	株式	44銘柄	4.2%	6.0%
チェコ・コルナ	株式	3銘柄	0.1%	0.2%
韓国・ウォン	株式	111銘柄	9.6%	13.7%
マレーシア・リングgit	株式	34銘柄	1.2%	1.8%
南アフリカ・ランド	株式	36銘柄	3.0%	4.3%
タイ・バーツ	株式	43銘柄	1.7%	2.5%
ポーランド・ズロチ	株式	14銘柄	0.5%	0.8%
ハンガリー・フォリント	株式	3銘柄	0.1%	0.2%
ユーロ	株式	9銘柄	0.2%	0.3%

(b)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オフショア・人民元	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	1,403,800.00	55,674,708.00	
		オフショア・人民元小計	1,403,800.00	55,674,708.00 (1,080,935,590)	
投資信託受益証券合計				1,080,935,590 (1,080,935,590)	
投資証券	アメリカ・ドル	ISHARES MSCI KUWAIT ETF	37,235.00	1,311,975.22	
		ISHARES MSCI QATAR ETF	82,108.00	1,672,539.96	
		ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	166,080.00	6,505,353.60	
		ISHARES MSCI UAE ETF	130,807.00	2,001,347.10	
	アメリカ・ドル小計			416,230.00	11,491,215.88 (1,595,785,149)

メキシコ・ペソ	CEMEX SAB-CPO	393,600.00	3,329,856.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	12,945.00	1,673,529.60	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	47,900.00	7,239,606.00	
	GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	54,100.00	1,118,247.00	
	TRUST FIBRA UNO	66,400.00	1,594,264.00	
メキシコ・ペソ小計		574,945.00	14,955,502.60 (108,011,631)	
ブラジル・リアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	29,100.00	729,246.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	7,800.00	214,968.00	
	ENERGISA SA-UNITS	4,800.00	207,072.00	
	KLABIN SA - UNIT	17,500.00	350,000.00	
ブラジル・リアル小計		59,200.00	1,501,286.00 (39,441,636)	
南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	72,006.00	1,018,164.84	
	南アフリカ・ランド小計		72,006.00	1,018,164.84 (8,308,225)
投資証券合計			1,751,546,641 (1,751,546,641)	
合 計			2,832,482,231 (2,832,482,231)	

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

通貨	銘柄数		組入 投資信託受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券	4銘柄	-	6.0%	56.3%
メキシコ・ペソ	投資証券	5銘柄	-	0.4%	3.8%
ブラジル・リアル	投資証券	4銘柄	-	0.1%	1.4%
オフショア・人民元	投資信託受益証券	1銘柄	4.1%	-	38.2%
南アフリカ・ランド	投資証券	1銘柄	-	0.0%	0.3%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

外国債券パッシブ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2021年11月30日現在)	(2022年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	396,577,581	444,208,536
金銭信託	32,775,079	152,609,385

コール・ローン	966,644,903	941,613,352
国債証券	158,467,947,570	151,679,008,052
未収入金	160,000,000	-
未収利息	923,046,863	973,583,208
前払費用	27,752,110	46,285,888
流動資産合計	160,974,744,106	154,237,308,421
資産合計	160,974,744,106	154,237,308,421
負債の部		
流動負債		
未払解約金	64,889,630	27,774,541
その他未払費用	4,621	3,600
流動負債合計	64,894,251	27,778,141
負債合計	64,894,251	27,778,141
純資産の部		
元本等		
元本	81,104,632,252	77,181,314,549
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	79,805,217,603	77,028,215,731
元本等合計	160,909,849,855	154,209,530,280
純資産合計	160,909,849,855	154,209,530,280
負債純資産合計	160,974,744,106	154,237,308,421

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>

3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。
----------------------------	---

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	（2021年11月30日現在）	（2022年11月30日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	81,104,632,252口	77,181,314,549口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.9840円 （1万口当たりの純資産額19,840円）	1口当たり純資産額 1.9980円 （1万口当たりの純資産額19,980円）

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項 目	(2022年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 2021年12月1日
至 2022年11月30日

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

(その他の注記)

(2021年11月30日現在)

開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	81,286,495,969円
同期中における追加設定元本額	2,319,084,008円
同期中における一部解約元本額	2,500,947,725円
2021年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	24,425,521,726円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	758,942,184円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,105,125,950円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,117,964,664円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	157,128,366円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	6,821,569円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	30,281,532円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	100,943,914円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	215,135,121円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	146,946,116円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	249,088,888円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	25,674,124円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	85,391,716円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	109,913,482円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	77,222,607円
イオン・バランス戦略ファンド	49,411,643円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	16,988,179円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	66,333,551円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	48,301,118円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	117,660,697円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	33,967,007円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	16,515,743円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	115,080,948円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	216,500,817円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	12,164,325円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	34,944,842円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	23,626,754円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,299,105円
日興F W S・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	127,761,903円
三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド	3,423,237円
S M A M・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	2,393,064,796円
S M A M・バランスファンドV A安定成長型<適格機関投資家限定>	44,105,389円
S M A M・バランスファンドV A 2 5<適格機関投資家専用>	7,457,552,993円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用>	4,630,256,069円
S M A M・バランスファンドV A 5 0<適格機関投資家専用>	10,737,712,617円
S M A M・バランスファンドV L 3 0<適格機関投資家限定>	35,392,217円
S M A M・バランスファンドV L 5 0<適格機関投資家限定>	93,650,011円

S M A M ・ バランスファンド V A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	726,204,731円
S M A M ・ バランスファンド V L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	117,631,749円
S M A M ・ インデックス・バランス V A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	1,068,564,548円
S M A M ・ インデックス・バランス V A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	1,446,325,136円
S M A M ・ バランスファンド V A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	1,571,810,158円
S M A M ・ バランスファンド V A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	4,949,497,571円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	632,409円
S M A M ・ 外国債券パッシブファンド V A < 適格機関投資家限定 >	8,245,225,547円
三井住友・外国債券インデックスファンド・ V A S (適格機関投資家専用)	334,892,322円
S M A M ・ グローバルバランス 4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	150,359,802円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	81,241,152円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	34,472,321円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	11,926,289円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	97,489,920円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	426,754,581円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	106,160,593円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	40,181,590円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	5,252,180円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	1,054,447,345円
S M A M ・ グローバルバランスファンド (標準型) V A < 適格機関投資家限定 >	661,340,146円
S M A M ・ グローバルバランスファンド (債券重視型) V A < 適格機関投資家限定 >	960,695,213円
S M A M ・ 世界バランスファンド V A < 適格機関投資家限定 >	1,204,599,718円
S M A M ・ 世界バランスファンド V A 2 < 適格機関投資家限定 >	418,833,625円
S M A M ・ 年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション ・ ファンド < 適格機関投資家限定 >	12,768,298円
S M A M ・ 年金 W リスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	141,011,485円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	245,134,628円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	265,817,919円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	836,545,356円
合 計	81,104,632,252円

(2022年11月30日現在)

開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	81,104,632,252円
同期中における追加設定元本額	11,875,698,156円
同期中における一部解約元本額	15,799,015,859円

2022年11月30日現在の元本の内訳

三井住友・ D C 外国債券インデックスファンド S	25,756,264,406円
三井住友・ D C 年金バランス 3 0 (債券重点型)	840,993,972円
三井住友・ D C 年金バランス 5 0 (標準型)	2,169,853,266円
三井住友・ D C 年金バランス 7 0 (株式重点型)	1,201,023,285円
S M A M ・ グローバルバランスファンド (機動的資産配分型)	153,754,294円
三井住友・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 2 0 (4 資産タイプ)	6,205,170円
三井住友・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 2 5 (4 資産タイプ)	28,041,920円
三井住友・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 3 0 (4 資産タイプ)	96,060,756円
三井住友・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 3 5 (4 資産タイプ)	254,625,421円

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	182,408,320円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	295,713,172円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	22,875,033円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	180,504,559円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	196,065,249円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	127,100,213円
イオン・バランス戦略ファンド	150,083,028円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	24,330,578円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	81,016,637円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	61,389,948円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	162,182,842円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	49,154,614円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	24,004,429円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	167,708,487円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	632,445,610円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	32,709,599円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	98,399,536円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	65,027,461円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	3,130,696円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	766,936,458円
三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド	40,133,426円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	3,677,884,570円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	30,152,077円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	5,820,669,217円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	3,997,274,168円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	9,331,565,400円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	30,338,011円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	75,478,804円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	631,815,767円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	109,386,082円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	949,869,564円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,268,921,919円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,336,489,741円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	4,160,020,552円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	604,716円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	7,097,718,053円
三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	315,261,191円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	122,294,061円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	67,641,422円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	31,256,873円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,592,229円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	79,935,071円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	365,865,953円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	87,335,608円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	37,410,392円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,460,174円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	898,659,693円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	557,262,211円

SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	740,186,895円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	424,473,864円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	280,587,013円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	110,869,714円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	14,708,323円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	19,121,369円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	623,061,467円
合計	77,181,314,549円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	T 0.125 02/15/24	7,700,000.00	7,284,277.00	
		T 0.25 05/31/25	4,400,000.00	3,977,160.00	
		T 0.25 06/30/25	2,900,000.00	2,619,512.00	
		T 0.25 07/31/25	300,000.00	269,928.00	
		T 0.25 09/30/25	2,000,000.00	1,791,780.00	
		T 0.25 10/31/25	1,000,000.00	892,300.00	
		T 0.25 11/15/23	3,000,000.00	2,874,480.00	
		T 0.375 04/30/25	3,000,000.00	2,728,110.00	
		T 0.375 07/31/27	2,500,000.00	2,120,200.00	
		T 0.375 09/15/24	3,000,000.00	2,786,130.00	
		T 0.375 09/30/27	4,800,000.00	4,047,744.00	
		T 0.375 11/30/25	2,000,000.00	1,785,140.00	
		T 0.375 12/31/25	3,000,000.00	2,673,150.00	
		T 0.5 03/31/25	600,000.00	549,510.00	
		T 0.5 04/30/27	1,200,000.00	1,031,616.00	
		T 0.5 05/31/27	2,500,000.00	2,141,775.00	
		T 0.5 06/30/27	4,000,000.00	3,418,120.00	
		T 0.5 10/31/27	1,000,000.00	846,990.00	
		T 0.625 03/31/27	2,400,000.00	2,077,392.00	
		T 0.625 05/15/30	7,500,000.00	5,984,400.00	
		T 0.625 07/31/26	3,600,000.00	3,171,924.00	
		T 0.625 08/15/30	7,000,000.00	5,552,960.00	
		T 0.625 10/15/24	4,400,000.00	4,094,904.00	
		T 0.625 11/30/27	2,100,000.00	1,785,147.00	
		T 0.625 12/31/27	7,200,000.00	6,105,600.00	
		T 0.75 01/31/28	5,900,000.00	5,023,496.00	
T 0.75 11/15/24	5,200,000.00	4,835,792.00			
T 0.875 01/31/24	2,000,000.00	1,912,340.00			

T 0.875 11/15/30	7,000,000.00	5,652,990.00	
T 1 07/31/28	5,900,000.00	5,027,626.00	
T 1 12/15/24	4,500,000.00	4,198,005.00	
T 1.125 01/15/25	2,000,000.00	1,866,000.00	
T 1.125 02/15/31	8,500,000.00	6,992,865.00	
T 1.125 02/28/25	1,500,000.00	1,395,930.00	
T 1.125 02/28/27	2,000,000.00	1,774,600.00	
T 1.125 05/15/40	2,000,000.00	1,272,180.00	
T 1.125 08/15/40	3,200,000.00	2,019,232.00	
T 1.125 08/31/28	3,500,000.00	2,999,325.00	
T 1.25 05/15/50	5,100,000.00	2,832,846.00	
T 1.25 06/30/28	3,000,000.00	2,599,200.00	
T 1.25 08/15/31	5,200,000.00	4,248,920.00	
T 1.25 09/30/28	4,500,000.00	3,875,265.00	
T 1.25 11/30/26	4,200,000.00	3,764,376.00	
T 1.25 12/31/26	2,300,000.00	2,057,672.00	
T 1.375 01/31/25	1,900,000.00	1,781,535.00	
T 1.375 08/15/50	4,500,000.00	2,583,270.00	
T 1.375 08/31/26	7,100,000.00	6,426,565.00	
T 1.375 10/31/28	6,000,000.00	5,194,680.00	
T 1.375 11/15/31	4,900,000.00	4,023,733.00	
T 1.375 11/15/40	2,000,000.00	1,318,900.00	
T 1.375 12/31/28	2,500,000.00	2,163,175.00	
T 1.5 01/31/27	4,400,000.00	3,971,000.00	
T 1.5 02/15/25	3,000,000.00	2,815,410.00	
T 1.5 02/15/30	2,100,000.00	1,801,569.00	
T 1.5 09/30/24	3,000,000.00	2,839,800.00	
T 1.5 10/31/24	5,500,000.00	5,198,325.00	
T 1.5 11/30/24	800,000.00	754,744.00	
T 1.5 11/30/28	2,300,000.00	2,004,220.00	
T 1.625 02/15/26	2,900,000.00	2,674,786.00	
T 1.625 05/15/26	14,950,000.00	13,734,714.50	
T 1.625 05/15/31	5,500,000.00	4,667,245.00	
T 1.625 08/15/29	450,000.00	392,076.00	
T 1.625 09/30/26	3,900,000.00	3,564,834.00	
T 1.625 10/31/23	3,000,000.00	2,917,260.00	
T 1.625 11/15/50	3,200,000.00	1,965,248.00	
T 1.625 11/30/26	200,000.00	182,022.00	
T 1.75 01/31/29	4,300,000.00	3,791,353.00	
T 1.75 03/15/25	1,500,000.00	1,414,560.00	
T 1.75 06/30/24	6,200,000.00	5,927,510.00	
T 1.75 07/31/24	850,000.00	810,687.50	
T 1.75 08/15/41	2,900,000.00	2,010,048.00	
T 1.75 11/15/29	1,300,000.00	1,143,337.00	

T 1.75 12/31/24	4,000,000.00	3,787,960.00	
T 1.75 12/31/26	3,500,000.00	3,198,650.00	
T 1.875 02/15/32	5,300,000.00	4,531,500.00	
T 1.875 02/15/41	2,800,000.00	2,008,776.00	
T 1.875 02/15/51	5,800,000.00	3,803,524.00	
T 1.875 02/28/27	3,400,000.00	3,114,434.00	
T 1.875 02/28/29	2,800,000.00	2,487,492.00	
T 1.875 08/31/24	3,800,000.00	3,624,516.00	
T 1.875 11/15/51	1,300,000.00	850,577.00	
T 2 02/15/25	3,500,000.00	3,321,710.00	
T 2 02/15/50	2,800,000.00	1,904,196.00	
T 2 04/30/24	2,000,000.00	1,925,220.00	
T 2 05/31/24	3,300,000.00	3,170,805.00	
T 2 06/30/24	4,100,000.00	3,935,016.00	
T 2 08/15/25	3,300,000.00	3,108,171.00	
T 2 08/15/51	2,900,000.00	1,960,893.00	
T 2 11/15/26	5,000,000.00	4,619,300.00	
T 2 11/15/41	3,800,000.00	2,750,516.00	
T 2.125 02/29/24	2,000,000.00	1,936,480.00	
T 2.125 03/31/24	6,500,000.00	6,283,160.00	
T 2.125 05/15/25	600,000.00	568,968.00	
T 2.125 07/31/24	3,500,000.00	3,358,740.00	
T 2.125 09/30/24	4,000,000.00	3,830,920.00	
T 2.125 11/30/23	3,100,000.00	3,022,252.00	
T 2.125 11/30/24	2,600,000.00	2,483,806.00	
T 2.25 01/31/24	2,200,000.00	2,137,938.00	
T 2.25 02/15/27	4,400,000.00	4,094,728.00	
T 2.25 02/15/52	1,700,000.00	1,221,994.00	
T 2.25 03/31/26	13,300,000.00	12,517,029.00	
T 2.25 04/30/24	3,800,000.00	3,672,320.00	
T 2.25 05/15/41	3,000,000.00	2,291,460.00	
T 2.25 08/15/27	4,200,000.00	3,890,250.00	
T 2.25 08/15/46	2,450,000.00	1,770,884.50	
T 2.25 08/15/49	3,500,000.00	2,534,490.00	
T 2.25 10/31/24	800,000.00	767,000.00	
T 2.25 11/15/24	5,100,000.00	4,885,800.00	
T 2.25 11/15/25	4,000,000.00	3,780,000.00	
T 2.25 11/15/27	4,400,000.00	4,060,012.00	
T 2.25 12/31/23	3,000,000.00	2,921,010.00	
T 2.25 12/31/24	3,900,000.00	3,729,960.00	
T 2.375 02/15/42	2,800,000.00	2,163,644.00	
T 2.375 02/29/24	3,700,000.00	3,594,476.00	
T 2.375 03/31/29	2,800,000.00	2,560,236.00	
T 2.375 05/15/27	3,000,000.00	2,799,120.00	

T 2.375 05/15/29	2,400,000.00	2,192,712.00	
T 2.375 05/15/51	1,400,000.00	1,035,888.00	
T 2.375 08/15/24	5,600,000.00	5,392,184.00	
T 2.375 11/15/49	1,900,000.00	1,415,044.00	
T 2.5 01/31/25	3,400,000.00	3,263,456.00	
T 2.5 02/15/45	3,600,000.00	2,759,040.00	
T 2.5 02/15/46	2,900,000.00	2,208,292.00	
T 2.5 02/28/26	2,100,000.00	1,992,438.00	
T 2.5 03/31/27	3,000,000.00	2,818,350.00	
T 2.5 05/15/24	5,700,000.00	5,522,274.00	
T 2.5 05/15/46	3,600,000.00	2,738,808.00	
T 2.625 01/31/26	2,700,000.00	2,574,801.00	
T 2.625 02/15/29	1,800,000.00	1,672,380.00	
T 2.625 03/31/25	1,000,000.00	962,690.00	
T 2.625 04/15/25	2,500,000.00	2,400,975.00	
T 2.625 05/31/27	3,000,000.00	2,832,060.00	
T 2.625 07/31/29	1,100,000.00	1,019,557.00	
T 2.625 12/31/23	1,900,000.00	1,857,250.00	
T 2.625 12/31/25	1,400,000.00	1,337,154.00	
T 2.75 02/15/24	5,100,000.00	4,980,252.00	
T 2.75 02/15/28	4,800,000.00	4,526,208.00	
T 2.75 02/28/25	2,000,000.00	1,930,000.00	
T 2.75 04/30/27	2,700,000.00	2,562,138.00	
T 2.75 05/15/25	3,000,000.00	2,888,670.00	
T 2.75 05/31/29	1,400,000.00	1,308,230.00	
T 2.75 06/30/25	900,000.00	866,772.00	
T 2.75 08/15/32	4,200,000.00	3,860,850.00	
T 2.75 08/15/42	2,000,000.00	1,638,280.00	
T 2.75 08/15/47	3,300,000.00	2,636,766.00	
T 2.75 08/31/25	3,400,000.00	3,266,652.00	
T 2.75 11/15/23	4,200,000.00	4,121,880.00	
T 2.75 11/15/42	300,000.00	245,049.00	
T 2.75 11/15/47	1,500,000.00	1,198,875.00	
T 2.875 04/30/25	400,000.00	386,280.00	
T 2.875 04/30/29	3,500,000.00	3,295,845.00	
T 2.875 05/15/28	9,000,000.00	8,522,190.00	
T 2.875 05/15/32	5,700,000.00	5,303,850.00	
T 2.875 05/15/43	2,400,000.00	1,996,872.00	
T 2.875 05/15/49	1,400,000.00	1,155,980.00	
T 2.875 05/15/52	1,700,000.00	1,407,005.00	
T 2.875 05/31/25	3,100,000.00	2,992,709.00	
T 2.875 06/15/25	2,000,000.00	1,931,480.00	
T 2.875 08/15/28	4,500,000.00	4,252,500.00	
T 2.875 08/15/45	3,300,000.00	2,702,106.00	

T 2.875 10/31/23	1,000,000.00	983,550.00	
T 2.875 11/15/46	800,000.00	654,432.00	
T 2.875 11/30/23	2,000,000.00	1,964,140.00	
T 2.875 11/30/25	2,500,000.00	2,407,025.00	
T 3 02/15/47	2,500,000.00	2,090,425.00	
T 3 02/15/48	2,400,000.00	2,012,808.00	
T 3 02/15/49	3,300,000.00	2,790,018.00	
T 3 05/15/42	800,000.00	686,368.00	
T 3 05/15/45	3,000,000.00	2,513,190.00	
T 3 05/15/47	1,800,000.00	1,506,852.00	
T 3 07/15/25	2,000,000.00	1,935,380.00	
T 3 08/15/48	900,000.00	757,188.00	
T 3 09/30/25	1,000,000.00	966,950.00	
T 3 10/31/25	2,600,000.00	2,512,146.00	
T 3 11/15/44	3,500,000.00	2,940,245.00	
T 3 11/15/45	2,700,000.00	2,260,170.00	
T 3.125 02/15/42	1,000,000.00	879,060.00	
T 3.125 02/15/43	2,300,000.00	1,996,492.00	
T 3.125 05/15/48	2,400,000.00	2,064,168.00	
T 3.125 08/15/25	3,000,000.00	2,911,500.00	
T 3.125 08/15/44	2,300,000.00	1,976,735.00	
T 3.125 11/15/28	2,900,000.00	2,774,024.00	
T 3.25 05/15/42	1,000,000.00	892,420.00	
T 3.25 06/30/29	3,000,000.00	2,887,830.00	
T 3.375 05/15/44	500,000.00	448,590.00	
T 3.375 08/15/42	3,000,000.00	2,728,110.00	
T 3.375 11/15/48	3,100,000.00	2,801,625.00	
T 3.5 02/15/39	200,000.00	191,186.00	
T 3.625 02/15/44	600,000.00	561,234.00	
T 3.625 08/15/43	2,400,000.00	2,252,040.00	
T 3.75 08/15/41	1,500,000.00	1,450,425.00	
T 3.75 11/15/43	700,000.00	668,444.00	
T 3.875 08/15/40	500,000.00	495,310.00	
T 3.875 09/30/29	3,500,000.00	3,501,610.00	
T 4.25 05/15/39	100,000.00	104,710.00	
T 4.25 10/15/25	2,000,000.00	1,999,440.00	
T 4.25 11/15/40	600,000.00	623,526.00	
T 4.375 05/15/40	900,000.00	952,380.00	
T 4.375 05/15/41	300,000.00	316,545.00	
T 4.375 11/15/39	300,000.00	318,138.00	
T 4.5 08/15/39	300,000.00	323,577.00	
T 4.625 02/15/40	200,000.00	218,578.00	
T 4.75 02/15/41	900,000.00	995,832.00	
T 5.25 11/15/28	500,000.00	532,850.00	

	T 5.375 02/15/31	320,000.00	355,049.60	
	T 6 02/15/26	1,000,000.00	1,052,650.00	
	T-BOND 15/11/2027	1,000,000.00	1,093,510.00	
	アメリカ・ドル小計	621,420,000.00	551,332,717.10 (76,563,574,424)	
カナダ・ ドル	CAN 0.5 09/01/25	2,700,000.00	2,474,874.00	
	CAN 1 06/01/27	1,100,000.00	1,000,659.00	
	CAN 1.25 06/01/30	5,700,000.00	5,039,769.00	
	CAN 1.5 04/01/25	700,000.00	663,726.00	
	CAN 1.5 06/01/26	3,200,000.00	2,998,240.00	
	CAN 1.5 09/01/24	2,200,000.00	2,110,064.00	
	CAN 1.5 12/01/31	2,300,000.00	2,029,382.00	
	CAN 1.75 12/01/53	600,000.00	446,658.00	
	CAN 2 06/01/28	700,000.00	663,565.00	
	CAN 2.25 03/01/24	1,000,000.00	977,560.00	
	CAN 2.25 06/01/25	500,000.00	482,700.00	
	CAN 2.25 06/01/29	1,600,000.00	1,531,296.00	
	CAN 2.25 12/01/29	1,600,000.00	1,528,208.00	
	CAN 2.5 06/01/24	2,100,000.00	2,054,220.00	
	CAN 2.75 12/01/48	1,300,000.00	1,230,502.00	
	CAN 3.5 12/01/45	1,200,000.00	1,281,372.00	
	CAN 4 06/01/41	1,900,000.00	2,135,505.00	
	CAN 5 06/01/37	600,000.00	732,222.00	
	CAN 5.75 06/01/29	250,000.00	290,070.00	
	CAN 5.75 06/01/33	400,000.00	496,496.00	
CANADA 2.75 12/01/64	700,000.00	652,316.00		
	カナダ・ドル小計	32,350,000.00	30,819,404.00 (3,148,510,313)	
オースト ラリア・ ドル	ACGB 0.25 11/21/25	800,000.00	732,792.00	
	ACGB 1.5 06/21/31	4,700,000.00	3,989,078.00	
	ACGB 1.75 06/21/51	500,000.00	311,070.00	
	ACGB 2.25 05/21/28	1,800,000.00	1,698,606.00	
	ACGB 2.5 05/21/30	2,600,000.00	2,428,712.00	
	ACGB 2.75 04/21/24	2,500,000.00	2,486,200.00	
	ACGB 2.75 06/21/35	800,000.00	720,000.00	
	ACGB 2.75 11/21/27	900,000.00	875,655.00	
	ACGB 2.75 11/21/28	200,000.00	192,832.00	
	ACGB 2.75 11/21/29	1,800,000.00	1,719,108.00	
	ACGB 3 03/21/47	1,200,000.00	1,010,616.00	
	ACGB 3 11/21/33	1,000,000.00	942,640.00	
	ACGB 3.25 04/21/25	1,300,000.00	1,302,210.00	
	ACGB 3.25 04/21/29	800,000.00	791,208.00	
	ACGB 3.25 06/21/39	2,000,000.00	1,832,300.00	
ACGB 3.75 04/21/37	1,200,000.00	1,185,780.00		

	ACGB 4.25 04/21/26	2,150,000.00	2,217,768.00	
	ACGB 4.5 04/21/33	900,000.00	969,264.00	
	オーストラリア・ドル小計	27,150,000.00	25,405,839.00 (2,357,407,801)	
シンガ ポール・ ドル	SIGB 1.25 11/01/26	500,000.00	468,650.00	
	SIGB 1.625 07/01/31	1,000,000.00	892,750.00	
	SIGB 2.25 08/01/36	800,000.00	732,888.00	
	SIGB 2.625 05/01/28	800,000.00	786,480.00	
	SIGB 2.75 03/01/46	800,000.00	789,600.00	
	SIGB 2.75 04/01/42	600,000.00	589,584.00	
	SIGB 2.875 09/01/30	200,000.00	197,100.00	
	SIGB 3 09/01/24	1,000,000.00	998,740.00	
	SIGB 3.375 09/01/33	300,000.00	309,450.00	
	SIGB 3.5 03/01/27	1,100,000.00	1,123,100.00	
	シンガポール・ドル小計	7,100,000.00	6,888,342.00 (695,998,076)	
ニュー ジーラン ド・ドル	NZGB 1.75 05/15/41	500,000.00	337,135.00	
	NZGB 2 05/15/32	300,000.00	251,061.00	
	NZGB 2.75 04/15/25	1,100,000.00	1,053,899.00	
	NZGB 2.75 05/15/51	500,000.00	374,995.00	
	NZGB 3 04/20/29	600,000.00	560,268.00	
	NZGB 4.5 04/15/27	1,100,000.00	1,106,303.00	
	ニュージーランド・ドル小計	4,100,000.00	3,683,661.00 (317,273,722)	
イギリ ス・ボン ド	UK TSY GILT	400,000.00	285,812.00	
	UKT 0.125 01/30/26	1,300,000.00	1,185,379.00	
	UKT 0.125 01/31/28	500,000.00	427,500.00	
	UKT 0.25 01/31/25	700,000.00	654,220.00	
	UKT 0.25 07/31/31	1,300,000.00	1,017,068.00	
	UKT 0.375 10/22/26	900,000.00	807,741.00	
	UKT 0.375 10/22/30	1,800,000.00	1,456,146.00	
	UKT 0.5 01/31/29	1,600,000.00	1,358,048.00	
	UKT 0.5 10/22/61	100,000.00	43,410.00	
	UKT 0.625 06/07/25	2,900,000.00	2,724,753.00	
	UKT 0.625 07/31/35	1,300,000.00	937,898.00	
	UKT 0.875 10/22/29	500,000.00	430,665.00	
	UKT 1 01/31/32	1,000,000.00	827,620.00	
	UKT 1 04/22/24	800,000.00	775,920.00	
	UKT 1.125 10/22/73	300,000.00	161,589.00	
	UKT 1.25 07/22/27	200,000.00	183,274.00	
	UKT 1.25 07/31/51	500,000.00	307,955.00	
	UKT 1.5 07/22/26	1,100,000.00	1,037,971.00	
	UKT 1.5 07/22/47	2,000,000.00	1,363,940.00	
	UKT 1.625 10/22/28	300,000.00	275,742.00	

	UKT 1.625 10/22/54	500,000.00	338,230.00	
	UKT 1.75 01/22/49	1,250,000.00	898,562.50	
	UKT 1.75 09/07/37	100,000.00	80,715.00	
	UKT 2 09/07/25	1,100,000.00	1,067,055.00	
	UKT 2.5 07/22/65	1,600,000.00	1,392,976.00	
	UKT 2.75 09/07/24	900,000.00	891,171.00	
	UKT 3.25 01/22/44	1,600,000.00	1,542,896.00	
	UKT 3.5 01/22/45	1,250,000.00	1,255,237.50	
	UKT 3.5 07/22/68	1,300,000.00	1,439,295.00	
	UKT 3.75 07/22/52	1,200,000.00	1,288,368.00	
	UKT 4 01/22/60	1,300,000.00	1,533,168.00	
	UKT 4.25 03/07/36	900,000.00	985,653.00	
	UKT 4.25 06/07/32	500,000.00	547,845.00	
	UKT 4.25 09/07/39	600,000.00	658,506.00	
	UKT 4.25 12/07/27	900,000.00	940,275.00	
	UKT 4.25 12/07/40	600,000.00	662,118.00	
	UKT 4.25 12/07/46	1,500,000.00	1,693,215.00	
	UKT 4.25 12/07/49	900,000.00	1,029,672.00	
	UKT 4.25 12/07/55	1,700,000.00	2,025,890.00	
	UKT 4.5 09/07/34	1,100,000.00	1,234,706.00	
	UKT 4.5 12/07/42	1,050,000.00	1,209,337.50	
	UKT 4.75 12/07/30	1,150,000.00	1,286,482.00	
	UKT 4.75 12/07/38	1,000,000.00	1,160,330.00	
	UKT 5 03/07/25	1,300,000.00	1,349,842.00	
	UKT 6 12/07/28	650,000.00	745,556.50	
	イギリス・ボンド小計	45,450,000.00	43,519,753.00 (7,234,288,541)	
イスラエル・シュケル	ILGOV 0.5 04/30/25	4,500,000.00	4,203,225.00	
	ILGOV 1 03/31/30	700,000.00	595,455.00	
	ILGOV 1.5 11/30/23	2,200,000.00	2,164,184.00	
	ILGOV 2.25 09/28/28	500,000.00	471,275.00	
	ILGOV 3.75 03/31/47	3,600,000.00	3,716,856.00	
	ILGOV 6.25 10/30/26	2,600,000.00	2,872,168.00	
	イスラエル・シュケル小計	14,100,000.00	14,023,163.00 (565,610,255)	
デンマーク・クローネ	DGB 0.25 11/15/52	1,800,000.00	1,151,784.00	
	DGB 0.5 11/15/27	8,000,000.00	7,419,520.00	
	DGB 0.5 11/15/29	4,800,000.00	4,306,560.00	
	DGB 1.5 11/15/23	1,900,000.00	1,890,291.00	
	DGB 1.75 11/15/25	3,600,000.00	3,565,080.00	
	DGB 4.5 11/15/39	8,200,000.00	10,976,356.00	
	デンマーク・クローネ小計	28,300,000.00	29,309,591.00 (565,968,201)	
ノル	NGB 1.375 08/19/30	4,200,000.00	3,701,502.00	

ウェー・ クローネ	NGB 1.5 02/19/26	3,000,000.00	2,833,980.00	
	NGB 1.75 03/13/25	3,000,000.00	2,891,730.00	
	NGB 1.75 09/06/29	4,700,000.00	4,309,524.00	
	NGB 2 04/26/28	5,900,000.00	5,561,222.00	
	NGB 3 03/14/24	2,800,000.00	2,784,656.00	
ノルウェー・クローネ小計		23,600,000.00	22,082,614.00	(306,948,335)
スウェー デン・ク ローナ	SGB 0.75 05/12/28	3,700,000.00	3,464,347.00	
	SGB 0.75 11/12/29	5,000,000.00	4,614,750.00	
	SGB 1 11/12/26	5,000,000.00	4,782,550.00	
	SGB 1.5 11/13/23	6,400,000.00	6,341,120.00	
	SGB 2.5 05/12/25	5,000,000.00	5,011,400.00	
	SGB 3.5 03/30/39	4,600,000.00	5,743,330.00	
スウェーデン・クローナ小計		29,700,000.00	29,957,497.00	(393,641,511)
メキシ コ・ペソ	MBONO 10 12/05/24	32,000,000.00	31,885,760.00	
	MBONO 5.75 03/05/26	19,000,000.00	16,992,840.00	
	MBONO 7.5 06/03/27	16,000,000.00	14,948,800.00	
	MBONO 7.75 05/29/31	21,000,000.00	19,226,550.00	
	MBONO 7.75 11/23/34	18,000,000.00	16,098,300.00	
	MBONO 8 11/07/47	5,000,000.00	4,417,350.00	
	MBONO 8 12/07/23	21,000,000.00	20,440,770.00	
	MBONO 8.5 05/31/29	18,000,000.00	17,371,980.00	
	MBONO 8.5 11/18/38	40,000,000.00	37,472,400.00	
メキシコ・ペソ小計		190,000,000.00	178,854,750.00	(1,291,724,774)
オフショ ア・人民 元	CGB 2.18 08/25/25	2,000,000.00	1,986,660.00	
	CGB 2.24 05/25/25	31,000,000.00	30,835,080.00	
	CGB 2.26 02/24/25	22,000,000.00	21,920,580.00	
	CGB 2.47 09/02/24	26,000,000.00	26,041,600.00	
	CGB 2.48 04/15/27	9,000,000.00	8,919,540.00	
	CGB 2.5 07/25/27	4,000,000.00	3,971,200.00	
	CGB 2.62 09/25/29	6,000,000.00	5,905,140.00	
	CGB 2.69 08/12/26	51,000,000.00	51,147,390.00	
	CGB 2.8 03/24/29	14,000,000.00	13,965,420.00	
	CGB 2.91 10/14/28	23,000,000.00	23,183,540.00	
	CGB 3.02 05/27/31	42,000,000.00	42,495,600.00	
	CGB 3.72 04/12/51	27,000,000.00	29,085,750.00	
オフショア・人民元小計		257,000,000.00	259,457,500.00	(5,037,419,254)
マレーシ ア・リン ギット	MALAYSIA GOVT	700,000.00	700,014.00	
	MALAYSIA GOVT	1,500,000.00	1,501,770.00	
	MALAYSIA GOVT	1,300,000.00	1,296,659.00	
	MALAYSIA GOVT	1,400,000.00	1,283,464.00	

	MGS 3.502 05/31/27	5,100,000.00	4,997,694.00	
	MGS 3.955 09/15/25	3,200,000.00	3,206,112.00	
	MGS 4.498 04/15/30	6,000,000.00	6,097,200.00	
	MGS 4.736 03/15/46	6,700,000.00	6,840,231.00	
	マレーシア・リングット小計	25,900,000.00	25,923,144.00 (798,165,827)	
ポーランド・ズロチ	POLGB 0.25 10/25/26	7,000,000.00	5,421,780.00	
	POLGB 0.75 04/25/25	1,800,000.00	1,568,070.00	
	POLGB 1.25 10/25/30	7,800,000.00	5,250,648.00	
	POLGB 2.25 10/25/24	8,000,000.00	7,347,920.00	
	POLGB 2.75 04/25/28	1,600,000.00	1,313,328.00	
	ポーランド・ズロチ小計	26,200,000.00	20,901,746.00 (641,932,333)	
ユーロ	BGB 0 10/22/31	1,300,000.00	1,055,132.00	
	BGB 0.1 06/22/30	200,000.00	170,142.00	
	BGB 0.35 06/22/32	300,000.00	246,096.00	
	BGB 0.4 06/22/40	300,000.00	203,697.00	
	BGB 0.5 10/22/24	1,300,000.00	1,262,170.00	
	BGB 0.65 06/22/71	400,000.00	200,148.00	
	BGB 0.8 06/22/25	300,000.00	290,799.00	
	BGB 0.8 06/22/27	800,000.00	752,784.00	
	BGB 0.8 06/22/28	1,600,000.00	1,486,912.00	
	BGB 0.9 06/22/29	900,000.00	826,380.00	
	BGB 1 06/22/26	1,800,000.00	1,732,428.00	
	BGB 1 06/22/31	1,300,000.00	1,168,180.00	
	BGB 1.25 04/22/33	1,100,000.00	981,552.00	
	BGB 1.45 06/22/37	400,000.00	340,480.00	
	BGB 1.6 06/22/47	650,000.00	521,995.50	
	BGB 1.7 06/22/50	500,000.00	403,985.00	
	BGB 1.9 06/22/38	1,000,000.00	898,630.00	
	BGB 2.15 06/22/66	500,000.00	449,325.00	
	BGB 2.25 06/22/57	500,000.00	459,725.00	
	BGB 2.6 06/22/24	400,000.00	402,864.00	
	BGB 3 06/22/34	200,000.00	207,776.00	
	BGB 3.75 06/22/45	800,000.00	934,232.00	
	BGB 4 03/28/32	500,000.00	564,090.00	
	BGB 4.25 03/28/41	1,000,000.00	1,213,260.00	
	BGB 4.5 03/28/26	700,000.00	754,320.00	
	BGB 5 03/28/35	1,000,000.00	1,246,290.00	
	BGB 5.5 03/28/28	1,100,000.00	1,285,867.00	
BTPS	2,400,000.00	2,296,320.00		
BTPS 0 12/15/24	1,300,000.00	1,235,962.00		
BTPS 0.35 02/01/25	2,400,000.00	2,282,976.00		
BTPS 0.5 02/01/26	1,000,000.00	924,700.00		

BTPS 0.85 01/15/27	1,700,000.00	1,556,945.00	
BTPS 0.9 04/01/31	2,000,000.00	1,617,800.00	
BTPS 0.95 06/01/32	1,500,000.00	1,175,265.00	
BTPS 0.95 08/01/30	1,800,000.00	1,487,610.00	
BTPS 0.95 09/15/27	800,000.00	722,720.00	
BTPS 0.95 12/01/31	2,600,000.00	2,065,154.00	
BTPS 1.1 04/01/27	1,800,000.00	1,654,056.00	
BTPS 1.25 12/01/26	800,000.00	747,504.00	
BTPS 1.45 03/01/36	400,000.00	302,676.00	
BTPS 1.45 05/15/25	700,000.00	678,622.00	
BTPS 1.45 11/15/24	1,800,000.00	1,762,434.00	
BTPS 1.5 06/01/25	1,900,000.00	1,839,333.00	
BTPS 1.6 06/01/26	1,200,000.00	1,144,332.00	
BTPS 1.65 12/01/30	2,200,000.00	1,910,282.00	
BTPS 1.7 09/01/51	1,500,000.00	980,700.00	
BTPS 1.85 05/15/24	1,500,000.00	1,483,470.00	
BTPS 1.85 07/01/25	1,000,000.00	973,620.00	
BTPS 2 02/01/28	3,200,000.00	3,015,232.00	
BTPS 2 12/01/25	1,300,000.00	1,265,472.00	
BTPS 2.05 08/01/27	1,500,000.00	1,430,265.00	
BTPS 2.1 07/15/26	1,000,000.00	968,740.00	
BTPS 2.2 06/01/27	900,000.00	867,177.00	
BTPS 2.25 09/01/36	500,000.00	417,810.00	
BTPS 2.45 09/01/33	1,100,000.00	962,368.00	
BTPS 2.45 09/01/50	900,000.00	694,530.00	
BTPS 2.5 11/15/25	1,200,000.00	1,186,992.00	
BTPS 2.5 12/01/24	1,300,000.00	1,296,750.00	
BTPS 2.7 03/01/47	1,550,000.00	1,288,685.50	
BTPS 2.8 03/01/67	600,000.00	468,696.00	
BTPS 2.8 12/01/28	1,600,000.00	1,557,264.00	
BTPS 2.95 09/01/38	600,000.00	532,080.00	
BTPS 3 08/01/29	3,100,000.00	3,027,987.00	
BTPS 3.1 03/01/40	500,000.00	447,620.00	
BTPS 3.25 09/01/46	1,500,000.00	1,369,140.00	
BTPS 3.35 03/01/35	850,000.00	801,847.50	
BTPS 3.45 03/01/48	1,000,000.00	940,210.00	
BTPS 3.5 03/01/30	3,400,000.00	3,416,898.00	
BTPS 3.75 09/01/24	2,300,000.00	2,343,700.00	
BTPS 3.85 09/01/49	1,100,000.00	1,100,506.00	
BTPS 4 02/01/37	2,600,000.00	2,643,290.00	
BTPS 4.5 03/01/24	1,000,000.00	1,023,400.00	
BTPS 4.5 03/01/26	1,800,000.00	1,884,852.00	
BTPS 4.75 09/01/28	2,000,000.00	2,150,640.00	
BTPS 4.75 09/01/44	800,000.00	894,688.00	

BTPS 5 03/01/25	1,000,000.00	1,049,730.00	
BTPS 5 08/01/34	2,070,000.00	2,278,614.60	
BTPS 5 08/01/39	1,800,000.00	2,029,230.00	
BTPS 5 09/01/40	1,700,000.00	1,928,123.00	
BTPS 5.75 02/01/33	1,700,000.00	1,974,805.00	
BTPS 6 05/01/31	2,200,000.00	2,595,890.00	
BTPS 6.5 11/01/27	1,700,000.00	1,960,933.00	
BTPS 7.25 11/01/26	400,000.00	463,912.00	
BTPS 9 11/01/23	300,000.00	317,535.00	
DBR 0 02/15/30	800,000.00	700,248.00	
DBR 0 02/15/32	3,200,000.00	2,694,400.00	
DBR 0 05/15/35	3,600,000.00	2,822,544.00	
DBR 0 08/15/29	2,500,000.00	2,209,700.00	
DBR 0 08/15/30	5,800,000.00	5,035,154.00	
DBR 0 08/15/31	1,500,000.00	1,277,805.00	
DBR 0 08/15/50	3,000,000.00	1,864,080.00	
DBR 0 11/15/27	1,300,000.00	1,186,302.00	
DBR 0.25 02/15/27	2,300,000.00	2,150,132.00	
DBR 0.25 02/15/29	1,800,000.00	1,631,952.00	
DBR 0.25 08/15/28	1,500,000.00	1,369,875.00	
DBR 0.5 02/15/25	2,500,000.00	2,421,775.00	
DBR 0.5 02/15/26	3,100,000.00	2,964,096.00	
DBR 0.5 02/15/28	2,100,000.00	1,958,754.00	
DBR 0.5 08/15/27	2,300,000.00	2,160,597.00	
DBR 1 05/15/38	1,000,000.00	870,030.00	
DBR 1 08/15/24	1,300,000.00	1,279,122.00	
DBR 1 08/15/25	1,300,000.00	1,267,643.00	
DBR 1.25 08/15/48	1,450,000.00	1,295,299.50	
DBR 1.5 05/15/24	2,200,000.00	2,183,984.00	
DBR 1.75 02/15/24	2,200,000.00	2,194,060.00	
DBR 2.5 07/04/44	1,900,000.00	2,113,712.00	
DBR 2.5 08/15/46	2,700,000.00	3,048,192.00	
DBR 3.25 07/04/42	700,000.00	849,450.00	
DBR 4 01/04/37	1,800,000.00	2,250,468.00	
DBR 4.25 07/04/39	700,000.00	921,431.00	
DBR 4.75 07/04/28	1,600,000.00	1,836,128.00	
DBR 4.75 07/04/34	600,000.00	775,248.00	
DBR 4.75 07/04/40	1,450,000.00	2,041,571.00	
DBR 5.5 01/04/31	900,000.00	1,138,635.00	
DBR 5.625 01/04/28	1,000,000.00	1,177,000.00	
DBR 6.25 01/04/24	1,200,000.00	1,256,784.00	
DBR 6.25 01/04/30	500,000.00	643,900.00	
DBR 6.5 07/04/27	1,000,000.00	1,197,180.00	
FRTR 0 02/25/24	400,000.00	389,704.00	

FRTR 0 02/25/25	3,000,000.00	2,856,300.00	
FRTR 0 02/25/26	3,800,000.00	3,544,716.00	
FRTR 0 03/25/24	4,800,000.00	4,667,280.00	
FRTR 0 03/25/25	1,900,000.00	1,806,292.00	
FRTR 0 05/25/32	1,900,000.00	1,526,479.00	
FRTR 0 11/25/29	4,500,000.00	3,862,440.00	
FRTR 0 11/25/30	3,900,000.00	3,266,328.00	
FRTR 0 11/25/31	3,000,000.00	2,449,680.00	
FRTR 0.25 11/25/26	3,200,000.00	2,972,064.00	
FRTR 0.5 05/25/25	1,300,000.00	1,248,078.00	
FRTR 0.5 05/25/26	3,500,000.00	3,307,045.00	
FRTR 0.5 05/25/29	2,300,000.00	2,064,572.00	
FRTR 0.5 05/25/72	100,000.00	46,611.00	
FRTR 0.5 06/25/44	800,000.00	528,608.00	
FRTR 0.75 02/25/28	500,000.00	464,360.00	
FRTR 0.75 05/25/28	3,300,000.00	3,055,965.00	
FRTR 0.75 05/25/52	3,000,000.00	1,897,500.00	
FRTR 0.75 11/25/28	3,500,000.00	3,217,760.00	
FRTR 1 05/25/27	1,800,000.00	1,711,980.00	
FRTR 1 11/25/25	1,000,000.00	967,280.00	
FRTR 1.25 05/25/34	1,200,000.00	1,048,008.00	
FRTR 1.25 05/25/36	3,700,000.00	3,136,120.00	
FRTR 1.5 05/25/31	2,550,000.00	2,410,158.00	
FRTR 1.5 05/25/50	2,400,000.00	1,890,096.00	
FRTR 1.75 05/25/66	800,000.00	642,352.00	
FRTR 1.75 06/25/39	3,200,000.00	2,857,408.00	
FRTR 1.75 11/25/24	2,600,000.00	2,577,510.00	
FRTR 2 05/25/48	2,000,000.00	1,767,880.00	
FRTR 2.25 05/25/24	1,700,000.00	1,701,666.00	
FRTR 2.5 05/25/30	3,500,000.00	3,578,330.00	
FRTR 2.75 10/25/27	3,850,000.00	3,956,568.00	
FRTR 3.25 05/25/45	900,000.00	992,106.00	
FRTR 3.5 04/25/26	2,500,000.00	2,608,150.00	
FRTR 4 04/25/55	1,370,000.00	1,765,505.30	
FRTR 4 04/25/60	1,400,000.00	1,839,656.00	
FRTR 4 10/25/38	2,000,000.00	2,346,780.00	
FRTR 4.5 04/25/41	2,100,000.00	2,652,279.00	
FRTR 4.75 04/25/35	2,200,000.00	2,700,588.00	
FRTR 5.5 04/25/29	2,350,000.00	2,806,088.00	
FRTR 5.75 10/25/32	400,000.00	519,368.00	
FRTR 6 10/25/25	2,100,000.00	2,325,792.00	
IRISH 0 10/18/31	500,000.00	408,270.00	
IRISH 0.9 05/15/28	500,000.00	466,650.00	
IRISH 1 05/15/26	800,000.00	772,160.00	

IRISH 1.1 05/15/29	500,000.00	465,630.00	
IRISH 1.3 05/15/33	800,000.00	715,936.00	
IRISH 1.35 03/18/31	500,000.00	466,960.00	
IRISH 1.5 05/15/50	500,000.00	396,295.00	
IRISH 1.7 05/15/37	300,000.00	268,215.00	
IRISH 2 02/18/45	900,000.00	804,645.00	
IRISH 2.4 05/15/30	600,000.00	607,800.00	
IRISH 3.4 03/18/24	500,000.00	508,740.00	
IRISH 5.4 03/13/25	800,000.00	858,040.00	
NETHER 0 01/15/24	500,000.00	488,540.00	
NETHER 0 01/15/27	800,000.00	736,584.00	
NETHER 0 07/15/30	2,600,000.00	2,224,950.00	
NETHER 0.25 07/15/25	1,100,000.00	1,050,973.00	
NETHER 0.25 07/15/29	1,000,000.00	887,380.00	
NETHER 0.5 01/15/40	1,700,000.00	1,298,715.00	
NETHER 0.5 07/15/26	1,700,000.00	1,611,277.00	
NETHER 0.5 07/15/32	200,000.00	171,066.00	
NETHER 0.75 07/15/27	400,000.00	377,944.00	
NETHER 0.75 07/15/28	1,500,000.00	1,398,360.00	
NETHER 2 07/15/24	700,000.00	699,524.00	
NETHER 2.5 01/15/33	200,000.00	205,524.00	
NETHER 2.75 01/15/47	1,500,000.00	1,705,575.00	
NETHER 3.75 01/15/42	1,300,000.00	1,623,037.00	
NETHER 4 01/15/37	1,400,000.00	1,697,080.00	
NETHER 5.5 01/15/28	700,000.00	815,787.00	
OBL 0 04/05/24	1,300,000.00	1,265,901.00	
OBL 0 04/11/25	2,800,000.00	2,673,384.00	
OBL 0 04/16/27	3,300,000.00	3,038,112.00	
OBL 0 10/09/26	1,100,000.00	1,021,350.00	
OBL 0 10/10/25	1,800,000.00	1,704,078.00	
OBL 0 10/18/24	600,000.00	577,878.00	
RAGB 0 02/20/30	900,000.00	759,168.00	
RAGB 0 02/20/31	900,000.00	738,279.00	
RAGB 0.5 02/20/29	550,000.00	493,564.50	
RAGB 0.5 04/20/27	700,000.00	651,770.00	
RAGB 0.75 02/20/28	700,000.00	650,811.00	
RAGB 0.75 03/20/51	900,000.00	596,583.00	
RAGB 0.75 10/20/26	1,300,000.00	1,236,313.00	
RAGB 0.85 06/30/20	150,000.00	76,227.00	
RAGB 0.9 02/20/32	300,000.00	260,925.00	
RAGB 1.2 10/20/25	1,000,000.00	976,010.00	
RAGB 1.5 02/20/47	700,000.00	575,967.00	
RAGB 1.5 11/02/86	200,000.00	142,294.00	
RAGB 1.65 10/21/24	800,000.00	792,840.00	

RAGB 2.4 05/23/34	900,000.00	889,587.00	
RAGB 3.15 06/20/44	500,000.00	553,400.00	
RAGB 3.8 01/26/62	700,000.00	914,879.00	
RAGB 4.15 03/15/37	300,000.00	354,678.00	
RAGB 4.85 03/15/26	500,000.00	543,860.00	
RAGB 6.25 07/15/27	1,000,000.00	1,180,940.00	
RFGB 0.25 09/15/40	400,000.00	269,988.00	
RFGB 0.5 04/15/26	700,000.00	663,152.00	
RFGB 0.5 09/15/28	400,000.00	361,236.00	
RFGB 0.5 09/15/29	800,000.00	708,016.00	
RFGB 0.75 04/15/31	500,000.00	437,180.00	
RFGB 1.375 04/15/47	500,000.00	412,785.00	
RFGB 2 04/15/24	900,000.00	899,334.00	
RFGB 2.625 07/04/42	800,000.00	813,080.00	
RFGB 2.75 07/04/28	400,000.00	410,100.00	
RFGB 4 07/04/25	300,000.00	314,898.00	
SPGB 0 01/31/25	500,000.00	476,655.00	
SPGB 0.25 07/30/24	1,400,000.00	1,355,522.00	
SPGB 0.5 04/30/30	1,000,000.00	858,010.00	
SPGB 0.5 10/31/31	1,400,000.00	1,151,178.00	
SPGB 0.7 04/30/32	2,200,000.00	1,818,718.00	
SPGB 0.8 07/30/27	1,000,000.00	927,670.00	
SPGB 1 10/31/50	300,000.00	181,035.00	
SPGB 1.2 10/31/40	1,700,000.00	1,235,152.00	
SPGB 1.25 10/31/30	3,000,000.00	2,697,450.00	
SPGB 1.3 10/31/26	3,100,000.00	2,982,603.00	
SPGB 1.4 04/30/28	1,600,000.00	1,509,936.00	
SPGB 1.4 07/30/28	2,200,000.00	2,070,046.00	
SPGB 1.45 04/30/29	1,600,000.00	1,496,272.00	
SPGB 1.45 10/31/27	1,100,000.00	1,048,839.00	
SPGB 1.45 10/31/71	400,000.00	224,804.00	
SPGB 1.5 04/30/27	1,500,000.00	1,443,900.00	
SPGB 1.6 04/30/25	1,400,000.00	1,379,798.00	
SPGB 1.85 07/30/35	2,000,000.00	1,754,980.00	
SPGB 1.95 04/30/26	2,000,000.00	1,976,280.00	
SPGB 1.95 07/30/30	1,700,000.00	1,616,904.00	
SPGB 2.15 10/31/25	1,600,000.00	1,596,848.00	
SPGB 2.35 07/30/33	700,000.00	665,308.00	
SPGB 2.7 10/31/48	750,000.00	686,677.50	
SPGB 2.75 10/31/24	2,100,000.00	2,119,698.00	
SPGB 2.9 10/31/46	1,700,000.00	1,630,861.00	
SPGB 3.45 07/30/66	1,300,000.00	1,344,980.00	
SPGB 3.8 04/30/24	1,400,000.00	1,430,254.00	
SPGB 4.2 01/31/37	1,250,000.00	1,411,762.50	

	SPGB 4.4 10/31/23	1,000,000.00	1,018,950.00	
	SPGB 4.65 07/30/25	1,300,000.00	1,380,561.00	
	SPGB 4.7 07/30/41	1,500,000.00	1,829,325.00	
	SPGB 4.8 01/31/24	2,200,000.00	2,266,484.00	
	SPGB 4.9 07/30/40	1,200,000.00	1,486,596.00	
	SPGB 5.15 10/31/28	1,500,000.00	1,710,345.00	
	SPGB 5.15 10/31/44	1,000,000.00	1,312,820.00	
	SPGB 5.75 07/30/32	1,000,000.00	1,254,440.00	
	SPGB 5.9 07/30/26	500,000.00	563,395.00	
	SPGB 6 01/31/29	2,200,000.00	2,636,348.00	
	ユーロ小計	373,740,000.00	360,499,684.40 (51,760,544,686)	
	国債証券合計		151,679,008,052 (151,679,008,052)	
	合計		151,679,008,052 (151,679,008,052)	

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

通貨	銘柄数		組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券	207銘柄	49.6%	50.5%
カナダ・ドル	国債証券	21銘柄	2.0%	2.1%
オーストラリア・ドル	国債証券	18銘柄	1.5%	1.6%
シンガポール・ドル	国債証券	10銘柄	0.5%	0.5%
ニュージーランド・ドル	国債証券	6銘柄	0.2%	0.2%
イギリス・ポンド	国債証券	45銘柄	4.7%	4.8%
イスラエル・シケル	国債証券	6銘柄	0.4%	0.4%
デンマーク・クローネ	国債証券	6銘柄	0.4%	0.4%
ノルウェー・クローネ	国債証券	6銘柄	0.2%	0.2%
スウェーデン・クローナ	国債証券	6銘柄	0.3%	0.3%
メキシコ・ペソ	国債証券	9銘柄	0.8%	0.9%
オフショア・人民元	国債証券	12銘柄	3.3%	3.3%
マレーシア・リングgit	国債証券	8銘柄	0.5%	0.5%
ポーランド・ズロチ	国債証券	5銘柄	0.4%	0.4%
ユーロ	国債証券	261銘柄	33.6%	34.1%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

(2021年11月30日現在)

(2022年11月30日現在)

資産の部

流動資産

預金	27,046,991	78,573,387
金銭信託	1,124,192	2,587,805
コール・ローン	33,156,127	15,966,983
国債証券	1,001,457,353	2,894,688,630
派生商品評価勘定	45,617	21,511
未収利息	5,539,151	25,080,637
前払費用	4,001,235	6,190,809
流動資産合計	1,072,370,666	3,023,109,762
資産合計	1,072,370,666	3,023,109,762
負債の部		
流動負債		
未払金	26,565,295	-
その他未払費用	90	59
流動負債合計	26,565,385	59
負債合計	26,565,385	59
純資産の部		
元本等		
元本	1,047,048,040	3,247,890,526
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	1,242,759	224,780,823
元本等合計	1,045,805,281	3,023,109,703
純資産合計	1,045,805,281	3,023,109,703
負債純資産合計	1,072,370,666	3,023,109,762

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

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

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2021年11月30日現在)	(2022年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,047,048,040口	3,247,890,526口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 1,242,759円	元本の欠損 224,780,823円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9988円 (1万口当たりの純資産額9,988円)	1口当たり純資産額 0.9308円 (1万口当たりの純資産額9,308円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

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

・金融商品の時価等に関する事項

項 目	(2022年11月30日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

		契 約 額 等		
--	--	---------	--	--

区 分	種 類		うち	時 価	評 価 損 益
			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	32,946,900	-	32,992,517	45,617
	小計	32,946,900	-	32,992,517	45,617
合 計		32,946,900	-	32,992,517	45,617

(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち 1 年 超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	9,698,080	-	9,719,591	21,511
	小計	9,698,080	-	9,719,591	21,511
合 計		9,698,080	-	9,719,591	21,511

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

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

(その他の注記)

(2021年11月30日現在)	
開示対象ファンドの 期首における当該親投資信託の元本額	499,583,536円

同期中における追加設定元本額	555,508,748円
同期中における一部解約元本額	8,044,244円
2021年11月30日現在の元本の内訳	
日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジあり）	639,603,666円
日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジなし）	405,849,697円
三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド	1,594,677円
合計	1,047,048,040円

(2022年11月30日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	1,047,048,040円
同期中における追加設定元本額	2,892,281,882円
同期中における一部解約元本額	691,439,396円
2022年11月30日現在の元本の内訳	
日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジあり）	391,617,618円
日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジなし）	1,945,147,099円
三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド	12,227,737円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	176,545,209円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	425,820,622円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	296,532,241円
合計	3,247,890,526円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	ADGB 1.875 09/15/31	1,300,000.00	1,080,768.00	
		ADGB 2.5 04/16/25	500,000.00	479,980.00	
		ADGB 3.125 09/30/49	500,000.00	370,640.00	
		BRAZIL 2.875 06/06/25	600,000.00	566,184.00	
		BRAZIL 3.875 06/12/30	500,000.00	435,160.00	
		BRAZIL 4.75 01/14/50	200,000.00	145,020.00	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	200,000.00	173,202.00	
		CHILE 2.55 07/27/33	600,000.00	481,320.00	
		CHILE 2.75 01/31/27	400,000.00	371,256.00	
		CHILE 3.1 05/07/41	200,000.00	146,970.00	
		CHILE 3.5 01/25/50	200,000.00	148,754.00	
		CHILE 4.34 03/07/42	400,000.00	342,164.00	
		CHINA (PEOPLE'S)	200,000.00	164,024.00	
		CHINA 0.55 10/21/25	200,000.00	179,334.00	
		CHINA 1.25 10/26/26	700,000.00	630,700.00	

COLOM 3.125 04/15/31	600,000.00	438,960.00	
DOMREP 5.5 02/22/29	200,000.00	183,454.00	
DOMREP 5.875 01/30/60	600,000.00	440,706.00	
DOMREP 6 02/22/33	800,000.00	716,544.00	
INDON 3.05 03/12/51	200,000.00	143,498.00	
INDON 3.85 10/15/30	200,000.00	187,956.00	
INDON 4.75 01/08/26	200,000.00	198,400.00	
INDON 5.125 01/15/45	400,000.00	386,712.00	
KSA 2.25 02/02/33	1,400,000.00	1,139,474.00	
KSA 3.625 03/04/28	600,000.00	573,894.00	
KSA 5.25 01/16/50	200,000.00	196,368.00	
MEX 2.659 05/24/31	1,200,000.00	995,856.00	
MEX 4.5 01/31/50	300,000.00	240,225.00	
MEX 5 04/27/51	900,000.00	765,738.00	
OMAN 6 08/01/29	400,000.00	397,464.00	
OMAN 6.25 01/25/31	1,000,000.00	1,000,600.00	
PANAMA 2.252 09/29/32	600,000.00	451,920.00	
PANAMA 4.5 01/19/63	800,000.00	583,856.00	
PERU 2.783 01/23/31	800,000.00	673,776.00	
PERU 5.625 11/18/50	200,000.00	199,122.00	
PHILIP 1.648 06/10/31	200,000.00	159,528.00	
PHILIP 2.95 05/05/45	200,000.00	145,498.00	
PHILIP 3.7 02/02/42	200,000.00	163,730.00	
QATAR 3.4 04/16/25	200,000.00	195,366.00	
QATAR 3.75 04/16/30	1,100,000.00	1,061,742.00	
QATAR 4.4 04/16/50	900,000.00	828,216.00	
SOAF 4.85 09/30/29	400,000.00	363,496.00	
SOAF 5.75 09/30/49	300,000.00	227,952.00	
SOAF 5.875 06/22/30	400,000.00	379,936.00	
TURKEY 6.125 10/24/28	800,000.00	712,712.00	
TURKEY 6.375 10/14/25	400,000.00	384,656.00	
URUGUA 4.375 01/23/31	400,000.00	400,632.00	
URUGUA 4.975 04/20/55	200,000.00	191,130.00	
アメリカ・ドル小計	24,000,000.00	20,844,593.00 (2,894,688,630)	
国債証券合計		2,894,688,630 (2,894,688,630)	
合計		2,894,688,630 (2,894,688,630)	

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 48銘柄	95.8%	100.0%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

Jリート・インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2021年11月30日現在)	(2022年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	4,726,735	16,783,253
コール・ローン	139,406,953	103,554,152
投資証券	8,552,350,950	10,443,009,900
未収配当金	47,699,981	61,307,439
前払金	2,534,000	592,000
差入委託証拠金	1,930,000	2,300,000
流動資産合計	8,748,648,619	10,627,546,744
資産合計	8,748,648,619	10,627,546,744
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,918,400	746,400
未払金	69,676,777	60,516,485
未払解約金	9,270,489	2,127,632
その他未払費用	1,079	441
流動負債合計	81,866,745	63,390,958
負債合計	81,866,745	63,390,958
純資産の部		
元本等		
元本	3,284,744,165	3,913,179,470
剰余金		
剰余金又は欠損金()	5,382,037,709	6,650,976,316
元本等合計	8,666,781,874	10,564,155,786
純資産合計	8,666,781,874	10,564,155,786
負債純資産合計	8,748,648,619	10,627,546,744

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	（2021年11月30日現在）	（2022年11月30日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	3,284,744,165口	3,913,179,470口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.6385円 （1万口当たりの純資産額26,385円）	1口当たり純資産額 2.6996円 （1万口当たりの純資産額26,996円）

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券を組み入れております。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項 目	(2022年11月30日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券（投資証券）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p>

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

（デリバティブ取引に関する注記）

（2021年11月30日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引	リート指数先物取引 買建				
	TREIT 先物 0312月	42,968,400	-	40,050,000	2,918,400
	小計	42,968,400	-	40,050,000	2,918,400
合 計		42,968,400	-	40,050,000	2,918,400

（2022年11月30日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引	リート指数先物取引 買建				
	TREIT 先物 0412月	40,146,400	-	39,400,000	746,400
	小計	40,146,400	-	39,400,000	746,400
合 計		40,146,400	-	39,400,000	746,400

（注）1．時価の算定方法

リート指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2)リート指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

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

(その他の注記)

(2021年11月30日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	2,771,760,223円
同期中における追加設定元本額	791,184,769円
同期中における一部解約元本額	278,200,827円
2021年11月30日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	148,899,827円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	246,919,552円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	162,217,084円
イオン・バランス戦略ファンド	19,849,872円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	1,775,302,683円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	12,694,289円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	48,810,703円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	35,714,617円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	116,382,487円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	62,651,196円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	48,724,686円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	20,933,583円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,714,624円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	49,584,329円
日興FWS・Jリートインデックス	96,669,288円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	812,567円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	4,569,920円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	23,646,493円
SMAM・年金WRリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	59,278,592円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	79,044,868円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	85,607,210円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%)<適格機関投資家限定>	184,715,695円
合計	3,284,744,165円

(2022年11月30日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	3,284,744,165円
同期中における追加設定元本額	2,347,844,703円
同期中における一部解約元本額	1,719,409,398円
2022年11月30日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	123,734,117円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	226,924,020円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	145,809,464円
イオン・バランス戦略ファンド	20,352,708円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	2,243,436,891円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	18,736,291円

三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	60,011,376円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	46,032,543円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	162,453,627円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	92,074,182円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	72,660,790円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	30,209,555円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,455,740円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	167,299,338円
日興FWS・Jリートインデックス	374,896,546円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	43,763,199円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	3,324,665円
SMAM・年金WRリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	28,778,069円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	3,208,159円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	4,273,982円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%)<適格機関投資家限定>	42,744,208円
合計	3,913,179,470円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート	189	22,434,300	
	サンケイリアルエステート	300	27,930,000	
	SOSILA物流リート投	435	59,769,000	
	SOSILA物流リート新	13	1,786,200	
	東海道リート投資法	112	13,652,800	
	日本アコモデーションF	328	205,656,000	
	森ヒルズリート	1,117	180,395,500	
	産業ファンド	1,421	226,081,100	
	アドバンス・レジデンス	950	326,800,000	
	ケネディクスレジデンシャル	681	142,260,900	
	API投資法人	501	213,927,000	
	GLP投資法人	3,065	472,010,000	
	コンフォリア・レジデンシャル	442	139,451,000	
	日本プロロジスリート	1,556	525,150,000	
	星野リゾート・リート	167	115,063,000	
	ONEリート投資法人	165	41,728,500	
	イオンリート投資	1,053	168,058,800	
	ヒューリックリート投資法	890	153,436,000	
	日本リート投資法人	308	112,728,000	
	積水ハウス・リート投資	2,872	231,196,000	
トーセイ・リート投資法人	207	27,696,600		

ケネディクス商業リート	412	109,427,200	
ヘルスケア&メディカル投資	233	44,060,300	
サムティ・レジデンシャル	219	26,258,100	
野村不動産マスターF	3,071	529,747,500	
いちごホテルリート投資	153	15,682,500	
ラサールロジポート投資	1,164	187,753,200	
スターアジア不動産投	1,186	66,297,400	
マリモ地方創生リート	116	15,822,400	
三井不ロジパーク	375	187,312,500	
大江戸温泉リート	148	9,472,000	
投資法人みらい	1,163	54,544,700	
森トラスト・ホテルリート投	219	29,608,800	
三菱地所物流REIT	326	143,603,000	
CREロジスティクスファンド	366	75,139,800	
ザイマックス・リート	151	18,301,200	
タカラレーベン不動産投	417	43,284,600	
アドバンス・ロジスティクス	412	60,522,800	
日本ビルファンド	1,107	708,480,000	
ジャパンリアルエステイト	949	577,941,000	
日本都市ファンド	4,791	527,489,100	
オリックス不動産投資	1,893	366,295,500	
日本プライムリアルティ	650	255,450,000	
NTT都市開発リート投	915	134,962,500	
東急リアル・エステート	638	137,552,800	
グローバル・ワン不動産	646	69,251,200	
グローバル・ワン不動新	26	2,787,200	
ユナイテッドアーバン投資	2,126	327,829,200	
森トラスト総合リート	680	99,824,000	
インヴィンシブル投資法	4,186	199,462,900	
フロンティア不動産投資	352	186,208,000	
平和不動産リート	651	104,876,100	
日本ロジスティクス F	641	205,440,500	
福岡リート	488	85,058,400	
ケネディクス・オフィス投資	553	186,637,500	
いちごオフィスリート投	783	67,103,100	
大和証券オフィス投資	195	132,015,000	
阪急阪神リート	429	65,508,300	
スターツプロシード投資	163	38,174,600	
大和ハウスリート	1,431	440,032,500	
ジャパン・ホテル・リート	3,066	229,030,200	
大和証券リビング投	1,291	152,338,000	
ジャパンエクセレント投資	874	119,213,600	
投資証券 小計		10,443,009,900	
合計		10,443,009,900	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

外国リート・インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2021年11月30日現在)	(2022年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	99,344,009	179,631,581
金銭信託	2,954,229	25,566,164
コール・ローン	87,129,944	157,745,488
投資証券	17,620,715,349	24,586,639,159
派生商品評価勘定	13,752	1,047
未収入金	865,289	1,170,969
未収配当金	22,724,956	39,192,137
流動資産合計	17,833,747,528	24,989,946,545
資産合計	17,833,747,528	24,989,946,545
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,782	170,425
未払金	-	78,556,684
未払解約金	-	31,589,177
その他未払費用	482	371
流動負債合計	4,264	110,316,657
負債合計	4,264	110,316,657
純資産の部		
元本等		
元本	6,336,539,299	8,860,732,746
剰余金		
剰余金又は欠損金()	11,497,203,965	16,018,897,142
元本等合計	17,833,743,264	24,879,629,888
純資産合計	17,833,743,264	24,879,629,888
負債純資産合計	17,833,747,528	24,989,946,545

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	（2021年11月30日現在）	（2022年11月30日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	6,336,539,299口	8,860,732,746口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.8144円 （1万口当たりの純資産額28,144円）	1口当たり純資産額 2.8079円 （1万口当たりの純資産額28,079円）

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券を組み入れております。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項 目	(2022年11月30日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券（投資証券）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p>

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	69,000,000	-	69,002,662	2,662
	カナダ・ドル	1,500,000	-	1,499,857	143
	オーストラリア・ドル	4,800,000	-	4,806,426	6,426
	シンガポール・ドル	2,300,000	-	2,304,664	4,664
	イギリス・ポンド	4,300,000	-	4,296,374	3,626
	ユーロ	3,200,000	-	3,199,987	13
	小計	85,100,000	-	85,109,970	9,970
合 計		85,100,000	-	85,109,970	9,970

(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	130,100,000	-	130,003,672	96,328
	オーストラリア・ドル	14,300,000	-	14,243,620	56,380
	シンガポール・ドル	2,300,000	-	2,300,972	972
	イギリス・ポンド	1,800,000	-	1,782,358	17,642
	小計	148,500,000	-	148,330,622	169,378
合 計		148,500,000	-	148,330,622	169,378

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為

替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

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

(その他の注記)

(2021年11月30日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	5,762,256,649円
同期中における追加設定元本額	741,440,225円
同期中における一部解約元本額	167,157,575円
2021年11月30日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	19,396,868円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	21,022,305円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	15,960,970円
イオン・バランス戦略ファンド	50,669,415円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	5,353,435,552円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	4,309,173円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	47,287,876円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	34,006,806円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	110,231,658円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	59,478,823円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	46,479,633円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	60,151,937円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	593,880円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド	105,121,312円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	29,066,138円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	88,855,201円
三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド	819,793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>	49,064,588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>	27,536,734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>	36,234,944円

SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%)<適格機関投資家限定>	176,815,693円
合計	6,336,539,299円

(2022年11月30日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	6,336,539,299円
同期中における追加設定元本額	3,494,346,976円
同期中における一部解約元本額	970,153,529円
2022年11月30日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	12,940,527円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	17,073,331円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	12,567,990円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	7,380,775,925円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	6,434,883円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	58,606,602円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	44,014,413円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	153,929,966円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	87,821,388円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	69,286,976円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	89,559,984円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	845,457円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド	325,259,559円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	78,592,105円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	387,230,766円
三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド	31,002,495円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	36,000,406円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	31,377,238円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%)<適格機関投資家限定>	37,412,735円
合計	8,860,732,746円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	14,653.00	222,725.60	
		AGREE REALTY CORP	11,040.00	762,201.60	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	8,514.00	165,597.30	
		ALEXANDER'S INC	300.00	73,371.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	20,661.00	3,151,215.72	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	2,165.00	41,524.70	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	7,000.00	199,220.00	

AMERICAN HOMES 4 RENT- A	40,800.00	1,326,408.00	
AMERICOLD REALTY TRUST INC	36,548.00	1,078,531.48	
APARTMENT INCOME REIT CO	21,100.00	783,865.00	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	23,200.00	187,224.00	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	28,200.00	474,324.00	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	8,429.00	100,220.81	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	2,515.00	15,919.95	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	19,520.00	3,333,820.80	
BLUEROCK HOMES TRUST INC	468.00	11,695.32	
BOSTON PROPERTIES INC	20,247.00	1,431,260.43	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	8,400.00	30,324.00	
BRANDYWINE REALTY TRUST	20,191.00	136,894.98	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	41,500.00	956,575.00	
BROADSTONE NET LEASE INC	23,684.00	392,917.56	
BRT APARTMENTS CORP	500.00	10,105.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	14,475.00	1,704,431.25	
CARETRUST REIT INC	13,303.00	260,472.74	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	3,648.00	106,339.20	
CENTERSPACE	2,600.00	165,360.00	
CHATHAM LODGING TRUST	5,557.00	72,796.70	
CITY OFFICE REIT INC	4,603.00	45,017.34	
CLIPPER REALTY INC	800.00	5,864.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3,216.00	110,952.00	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	16,866.00	461,622.42	
COUSINS PROPERTIES INC	20,011.00	519,885.78	
CTO REALTY GROWTH INC	3,839.00	81,194.85	
CUBESMART	31,063.00	1,229,473.54	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	33,165.00	304,123.05	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	69,000.00	40,710.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	39,776.00	4,325,640.00	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	23,884.00	24,122.84	
DOUGLAS EMMETT INC	23,532.00	397,455.48	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	20,000.00	2,740.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	11,869.00	190,260.07	
EASTGROUP PROPERTIES INC	5,919.00	899,747.19	
ELME COMMUNITIES	10,790.00	207,491.70	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	21,276.00	162,548.64	
EPR PROPERTIES	11,259.00	459,029.43	
EQUINIX INC	12,620.00	8,467,515.20	
EQUITY COMMONWEALTH	14,758.00	394,186.18	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	23,766.00	1,555,009.38	
EQUITY RESIDENTIAL	47,128.00	2,996,398.24	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	19,710.00	446,825.70	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	8,849.00	1,898,022.01	

EXTRA SPACE STORAGE INC	18,533.00	2,845,186.16	
FARMLAND PARTNERS INC	4,666.00	61,404.56	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	10,122.00	1,114,027.32	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	18,640.00	919,511.20	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	11,500.00	306,820.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	15,115.00	44,589.25	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	35,357.00	1,823,360.49	
GETTY REALTY CORP	5,036.00	164,475.76	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5,368.00	99,630.08	
GLADSTONE LAND CORP	4,464.00	90,083.52	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	5,669.00	55,726.27	
GLOBAL NET LEASE INC	13,146.00	173,527.20	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	51,300.00	1,022,409.00	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	76,084.00	1,950,793.76	
HERSHA HOSPITALITY TRUST-A	2,876.00	27,293.24	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	13,846.00	405,549.34	
HOST HOTELS & RESORTS INC	99,100.00	1,849,206.00	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	17,289.00	194,328.36	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	32,400.00	568,944.00	
INDUS REALTY TRUST INC	823.00	52,540.32	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	6,274.00	25,033.26	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,822.00	450,422.70	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	8,406.00	208,636.92	
INVITATION HOMES INC	81,180.00	2,591,265.60	
IRON MOUNTAIN INC	40,229.00	2,166,733.94	
ISTAR INC	13,800.00	136,620.00	
JBG SMITH PROPERTIES	14,792.00	297,319.20	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	130,900.00	71,340.50	
KILROY REALTY CORP	14,505.00	608,049.60	
KIMCO REALTY CORP	85,800.00	1,949,376.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	30,324.00	681,986.76	
LIFE STORAGE INC	11,350.00	1,174,384.50	
LTC PROPERTIES INC	5,036.00	196,555.08	
LXP INDUSTRIAL TRUST	37,000.00	387,020.00	
MACERICH CO/THE	30,200.00	391,694.00	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	245,900.00	92,212.50	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	80,900.00	1,050,082.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	16,150.00	2,615,008.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	24,625.00	1,115,512.50	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	11,732.00	452,033.96	
NATL HEALTH INVESTORS INC	6,051.00	332,260.41	
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	17,023.00	112,181.57	
NETSTREIT CORP	8,448.00	164,567.04	
NEXPOINT RESIDENTIAL	3,529.00	164,910.17	

OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	5,071.00	77,332.75	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	33,565.00	1,009,635.20	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,352.00	55,765.92	
ORION OFFICE REIT INC	5,199.00	47,570.85	
PARAMOUNT GROUP INC	20,155.00	128,790.45	
PARK HOTELS & RESORTS INC	31,179.00	385,684.23	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	17,544.00	284,212.80	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	15,254.00	486,907.68	
PHYSICIANS REALTY TRUST	31,204.00	450,585.76	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	19,902.00	204,592.56	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,774.00	96,243.84	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	1,424.00	21,801.44	
PRIME US REIT	130,700.00	61,429.00	
PROLOGIS INC	127,900.00	14,556,299.00	
PUBLIC STORAGE	21,939.00	6,375,473.40	
REALTY INCOME CORP	86,021.00	5,359,108.30	
REGENCY CENTERS CORP	21,400.00	1,408,548.00	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	16,432.00	248,780.48	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	24,010.00	1,298,460.80	
RLJ LODGING TRUST	24,132.00	287,170.80	
RPT REALTY	11,788.00	131,082.56	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	7,817.00	701,732.09	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	32,679.00	421,559.10	
SAFEHOLD INC	2,310.00	66,181.50	
SAUL CENTERS INC	2,331.00	98,834.40	
SERVICE PROPERTIES TRUST	25,446.00	194,152.98	
SIMON PROPERTY GROUP INC	45,601.00	5,356,293.46	
SITE CENTERS CORP	26,013.00	349,874.85	
SL GREEN REALTY CORP	9,537.00	396,929.94	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	18,892.00	768,904.40	
STAG INDUSTRIAL INC	24,351.00	777,040.41	
STORE CAPITAL CORP	36,400.00	1,157,884.00	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	14,098.00	119,269.08	
SUN COMMUNITIES INC	17,270.00	2,500,868.70	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	29,379.00	316,705.62	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	15,336.00	298,745.28	
TERRENO REALTY CORP	8,800.00	506,000.00	
UDR INC	42,269.00	1,722,461.75	
UMH PROPERTIES INC	6,284.00	110,221.36	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,344.00	69,619.20	
URBAN EDGE PROPERTIES	15,028.00	235,037.92	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	2,927.00	54,822.71	
VENTAS INC	56,111.00	2,547,439.40	
VERIS RESIDENTIAL INC	10,798.00	170,716.38	

	VICI PROPERTIES INC	133,286.00	4,487,739.62	
	VORNADO REALTY TRUST	21,846.00	552,922.26	
	WELLTOWER INC	64,600.00	4,470,320.00	
	WHITESTONE REIT	4,511.00	43,215.38	
	WP CAREY INC	29,170.00	2,281,677.40	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	15,327.00	230,977.89	
	アメリカ・ドル小計	3,617,933.00	137,609,412.12 (19,109,819,061)	
カナダ・ ドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	8,800.00	233,376.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	9,662.00	90,049.84	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	2,725.00	31,010.50	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,190.00	159,723.30	
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	2,642.00	50,382.94	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	13,622.00	51,763.60	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	11,424.00	494,659.20	
	CHOICE PROPERTIES REIT	23,858.00	348,088.22	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	5,107.00	83,346.24	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	4,551.00	71,359.68	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	17,899.00	216,398.91	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,465.00	84,434.25	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	11,377.00	36,975.25	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	14,775.00	253,686.75	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4,448.00	356,551.68	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	16,425.00	204,984.00	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	1,387.00	6,199.89	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11,198.00	138,631.24	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	8,107.00	135,630.11	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,447.00	21,039.38	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1,557.00	25,612.65	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	4,345.00	45,535.60	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	20,754.00	210,238.02	
	PRIMARIS REIT	6,318.00	96,349.50	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	19,525.00	415,296.75	
	SLATE GROCERY REIT-CL U	3,196.00	50,081.32	
SLATE OFFICE REIT	3,663.00	16,593.39		
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	9,440.00	260,638.40		
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	13,800.00	310,500.00		
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4,770.00	28,715.40		
	カナダ・ドル小計	265,477.00	4,527,852.01 (462,565,361)	
オースト ラリア・ ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	50,980.00	137,646.00	
	ARENA REIT	45,981.00	177,946.47	
	BWP TRUST	66,965.00	274,556.50	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	104,758.00	196,945.04	

	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	84,443.00	269,373.17	
	CENTURIA OFFICE REIT	43,559.00	69,258.81	
	CHARTER HALL GROUP	64,246.00	873,103.14	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	97,225.00	427,790.00	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	62,449.00	253,542.94	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	37,955.00	127,149.25	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	158,718.00	111,896.19	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	30,237.00	87,384.93	
	DEXUS/AU	152,720.00	1,200,379.20	
	GDI PROPERTY GROUP	43,204.00	32,835.04	
	GOODMAN GROUP	236,100.00	4,412,709.00	
	GPT GROUP	273,000.00	1,193,010.00	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	30,439.00	98,013.58	
	HEALTHCO REIT	51,410.00	81,741.90	
	HMC CAPITAL LTD	33,678.00	174,452.04	
	HOMEKO DAILY NEEDS REIT	187,797.00	245,075.08	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	25,921.00	86,057.72	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	39,965.00	170,650.55	
	MIRVAC GROUP	534,373.00	1,186,308.06	
	NATIONAL STORAGE REIT	162,000.00	388,800.00	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	89,106.00	65,938.44	
	REGION RE LTD	143,852.00	394,154.48	
	RURAL FUNDS GROUP	52,739.00	135,011.84	
	SCENTRE GROUP	734,000.00	2,157,960.00	
	STOCKLAND	339,500.00	1,290,100.00	
	VICINITY CENTRES	530,100.00	1,076,103.00	
	WAYPOINT REIT	113,111.00	311,055.25	
	オーストラリア・ドル小計	4,620,531.00	17,706,947.62 (1,643,027,670)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	239,000.00	650,080.00	
	FORTUNE REIT	208,000.00	1,154,400.00	
	LINK REIT	294,700.00	15,501,220.00	
	PROSPERITY REIT	178,000.00	313,280.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	110,000.00	328,900.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	293,000.00	542,050.00	
	香港・ドル小計	1,322,700.00	18,489,930.00 (328,750,954)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT	113,300.00	139,359.00	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	456,600.00	1,260,216.00	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	260,055.00	245,751.97	
	CAPITALAND CHINA TRUST	205,700.00	215,985.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	721,208.00	1,500,112.64	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	94,950.00	113,940.00	
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	44,500.00	28,480.00	

	EC WORLD REIT	52,800.00	23,496.00	
	ESR-LOGOS REIT	864,913.00	302,719.55	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	190,000.00	116,850.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	176,400.00	43,218.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	141,800.00	289,272.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	370,238.00	414,666.56	
	KEPPEL DC REIT	170,900.00	317,874.00	
	KEPPEL REIT	275,800.00	248,220.00	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	262,000.00	189,950.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	273,200.00	617,432.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	432,950.00	697,049.50	
	MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	304,700.00	527,131.00	
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT	243,200.00	85,120.00	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	48,000.00	185,280.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT	66,700.00	50,692.00	
	SPH REIT	115,700.00	104,130.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	138,200.00	76,701.00	
	SUNTEC REIT	324,800.00	448,224.00	
	シンガポール・ドル小計	6,348,614.00	8,241,870.22 (832,758,567)	
ニュー ジーラン ド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	107,000.00	124,120.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	135,705.00	272,767.05	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	200,506.00	182,460.46	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND	192,441.00	232,853.61	
	STRIDE PROPERTY GROUP	90,554.00	134,019.92	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	57,519.00	132,868.89	
	ニュージーランド・ドル小計	783,725.00	1,079,089.93 (92,942,016)	
イギリ ス・ボン ド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	53,280.00	28,877.76	
	AEW UK REIT PLC	9,000.00	8,685.00	
	ASSURA PLC	378,833.00	208,736.98	
	BALANCED COMM PROPERTY TRUST	89,651.00	81,582.41	
	BIG YELLOW GROUP PLC	23,140.00	254,077.20	
	BRITISH LAND CO PLC	135,414.00	548,020.45	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES	125,000.00	129,625.00	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	108,964.00	66,359.07	
	CUSTODIAN REIT PLC	39,999.00	36,759.08	
	DERWENT LONDON PLC	15,701.00	375,881.94	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	95,000.00	83,315.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	30,485.00	154,406.52	
	HAMMERSON PLC	440,241.00	109,179.76	
	HOME REIT PLC	96,051.00	53,596.45	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	41,816.00	43,154.11	
INTU PROPERTIES PLC	28,500.00	285.00		

	LAND SECURITIES GROUP PLC	108,634.00	674,182.60	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	141,905.00	257,273.76	
	LXI REIT PLC	247,814.00	288,455.49	
	NEWRIVER REIT PLC	46,021.00	35,298.10	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	57,141.00	49,198.40	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	182,000.00	206,570.00	
	PRS REIT PLC/THE	89,207.00	75,825.95	
	REGIONAL REIT LTD	45,664.00	27,398.40	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	31,848.00	289,657.56	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	70,698.00	31,672.70	
	SEGRO PLC	167,300.00	1,352,453.20	
	SHAFTESBURY PLC	36,339.00	132,346.63	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	187,422.00	201,478.65	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	34,770.00	23,782.68	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	259,000.00	378,917.00	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	117,847.00	70,236.81	
	UNITE GROUP PLC/THE	55,500.00	525,307.50	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	76,400.00	106,578.00	
	WAREHOUSE REIT PLC	72,100.00	81,905.60	
	WORKSPACE GROUP PLC	20,210.00	85,649.98	
	イギリス・ポンド小計	3,758,895.00	7,076,730.74 (1,176,364,951)	
イスラエル・シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	110,000.00	194,590.00	
	REIT 1 LTD	26,169.00	490,145.37	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	25,500.00	223,048.50	
	イスラエル・シュケル小計	161,669.00	907,783.87 (36,614,555)	
韓国・ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	6,350.00	21,717,000.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	24,000.00	96,000,000.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	4,067.00	18,484,515.00	
	JR REIT XXVII	19,000.00	81,700,000.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	6,226.00	30,818,700.00	
	LOTTE REIT CO LTD	20,121.00	79,075,530.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	9,815.00	40,535,950.00	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	12,561.00	39,441,540.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	8,762.00	60,107,320.00	
	SK REITS CO LTD	12,831.00	58,958,445.00	
	韓国・ウォン小計	123,733.00	526,839,000.00 (55,212,727)	
ユーロ	AEDIFICA	5,710.00	433,103.50	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	850.00	6,205.00	
	ALTAREA	723.00	100,786.20	
	CARE PROPERTY INVEST	3,490.00	53,048.00	
	CARMILA	7,172.00	99,834.24	
	COFINIMMO	4,000.00	336,600.00	

COVIVIO	6,175.00	347,961.25	
CROMWELL REIT EUR	48,320.00	75,379.20	
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	5,801.00	135,859.42	
GECINA SA	7,550.00	715,362.50	
HAMBORNER REIT AG	9,937.00	74,030.65	
ICADE	3,844.00	155,605.12	
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	4,798.00	15,617.49	
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	42,359.00	253,095.02	
INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	4,899.00	102,389.10	
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	52,815.00	60,842.88	
KLEPIERRE	26,996.00	601,470.88	
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	6,940.00	30,813.60	
MERCIALYS	11,000.00	104,555.00	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	49,800.00	451,188.00	
MONTEA NV	1,880.00	122,012.00	
NSI NV	2,966.00	72,222.10	
RETAIL ESTATES	1,586.00	98,173.40	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	15,400.00	800,492.00	
VASTNED RETAIL NV	2,035.00	44,057.75	
WAREHOUSES DE PAUW SCA	18,467.00	474,971.24	
WERELDHAVE NV	5,522.00	74,933.54	
XIOR STUDENT HOUSING NV	2,441.00	69,568.50	
ユーロ小計	353,476.00	5,910,177.58 (848,583,297)	
投資証券合計		24,586,639,159 (24,586,639,159)	
合計		24,586,639,159 (24,586,639,159)	

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

通貨	銘柄数		組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券	145銘柄	76.8%	77.7%
カナダ・ドル	投資証券	30銘柄	1.9%	1.9%
オーストラリア・ドル	投資証券	31銘柄	6.6%	6.7%
香港・ドル	投資証券	6銘柄	1.3%	1.3%
シンガポール・ドル	投資証券	25銘柄	3.3%	3.4%
ニュージーランド・ドル	投資証券	6銘柄	0.4%	0.4%
イギリス・ポンド	投資証券	36銘柄	4.7%	4.8%
イスラエル・シケル	投資証券	3銘柄	0.1%	0.1%
韓国・ウォン	投資証券	10銘柄	0.2%	0.2%
ユーロ	投資証券	28銘柄	3.4%	3.5%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

ゴールド・インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2021年11月30日現在)	(2022年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	63,327,388	44,944,694
金銭信託	553,062	4,242,207
コール・ローン	16,311,621	26,174,794
投資信託受益証券	876,932,357	3,754,431,327
派生商品評価勘定	2,425	1,728
流動資産合計	957,126,853	3,829,794,750
資産合計	957,126,853	3,829,794,750
負債の部		
流動負債		
未払金	95,212,463	53,523,970
未払解約金	15,187	1,069,582
その他未払費用	55	122
流動負債合計	95,227,705	54,593,674
負債合計	95,227,705	54,593,674
純資産の部		
元本等		
元本	864,264,346	3,178,413,029
剰余金		
剰余金又は欠損金()	2,365,198	596,788,047
元本等合計	861,899,148	3,775,201,076
純資産合計	861,899,148	3,775,201,076
負債純資産合計	957,126,853	3,829,794,750

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	（2021年11月30日現在）	（2022年11月30日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	864,264,346口	3,178,413,029口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 2,365,198円	元本の欠損
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9973円 （1万口当たりの純資産額9,973円）	1口当たり純資産額 1.1878円 （1万口当たりの純資産額11,878円）

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券</p> <p>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引</p> <p>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p>

	<p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
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11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資信託受益証券）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2021年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	41,172,236	-	41,174,661	2,425
	小計	41,172,236	-	41,174,661	2,425
合 計		41,172,236	-	41,174,661	2,425

(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	39,987,446	-	39,989,174	1,728
	小計	39,987,446	-	39,989,174	1,728
合 計		39,987,446	-	39,989,174	1,728

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

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

（その他の注記）

（2021年11月30日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	2,862,026円
同期中における追加設定元本額	862,353,380円
同期中における一部解約元本額	951,060円
2021年11月30日現在の元本の内訳	
日興FWS・ゴールド（為替ヘッジあり）	138,779,891円
日興FWS・ゴールド（為替ヘッジなし）	688,097,982円
三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）	37,386,473円
合計	864,264,346円

（2022年11月30日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	864,264,346円
同期中における追加設定元本額	2,632,159,819円
同期中における一部解約元本額	318,011,136円
2022年11月30日現在の元本の内訳	
日興FWS・ゴールド（為替ヘッジあり）	316,496,322円
日興FWS・ゴールド（為替ヘッジなし）	2,580,676,358円
三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）	281,240,349円
合計	3,178,413,029円

（3）附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	iShares Gold Trust	249,190.00	8,270,616.10	
		SPDR Gold MiniShares Trust	540,310.00	18,764,966.30	
	アメリカ・ドル小計		789,500.00	27,035,582.40 (3,754,431,327)	
投資信託受益証券合計				3,754,431,327 (3,754,431,327)	
合計				3,754,431,327 (3,754,431,327)	

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

通貨	銘柄数		組入	合計金額に 対する比率
			投資信託受益証券 時価比率	
アメリカ・ドル	投資信託受益証券	2銘柄	99.4%	100.0%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

【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3期中間計算期間(2022年12月1日から2023年5月31日まで)の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により中間監査を受けております。

【三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	84	22
コール・ローン	519	1,197
親投資信託受益証券	61,811,019	130,673,036
流動資産合計	61,811,622	130,674,255
資産合計	61,811,622	130,674,255
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	4,635	9,718
未払委託者報酬	77,353	161,076
その他未払費用	1,065	2,370
流動負債合計	83,053	173,164
負債合計	83,053	173,164
純資産の部		
元本等		
元本	56,998,952	110,973,142
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	4,729,617	19,527,949
(分配準備積立金)	2,721,892	2,529,691
元本等合計	61,728,569	130,501,091
純資産合計	61,728,569	130,501,091
負債純資産合計	61,811,622	130,674,255

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第2期中間計算期間 自 2021年12月 1日 至 2022年 5月31日	第3期中間計算期間 自 2022年12月 1日 至 2023年 5月31日
営業収益		
有価証券売買等損益	120,679	10,141,997
営業収益合計	120,679	10,141,997
営業費用		
支払利息	-	9
受託者報酬	1,381	9,718
委託者報酬	23,713	161,076
その他費用	287	2,370
営業費用合計	25,381	173,173
営業利益又は営業損失（ ）	95,298	9,968,824
経常利益又は経常損失（ ）	95,298	9,968,824
中間純利益又は中間純損失（ ）	95,298	9,968,824
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（ ）	-	241,944
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	172,961	4,729,617
剰余金増加額又は欠損金減少額	302,070	5,594,922
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	302,070	5,594,922
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	523,470
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	523,470
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（ ）	570,329	19,527,949

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第3期中間計算期間 自 2022年12月1日 至 2023年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

項 目	第2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	56,998,952口	110,973,142口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0830円 (1万口当たりの純資産額10,830円)	1口当たり純資産額 1.1760円 (1万口当たりの純資産額11,760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3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <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>

3. 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。
----------------------------	--

(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2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
期首元本額	5,873,388円	56,998,952円
期中追加設定元本額	52,125,564円	60,376,239円
期中一部解約元本額	1,000,000円	6,402,049円

【三井住友D S ・日経225インデックス・ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	177	25
コール・ローン	1,094	1,350
親投資信託受益証券	272,785,410	299,420,898
流動資産合計	272,786,681	299,422,273
資産合計	272,786,681	299,422,273
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	20,288	30,527
未払委託者報酬	335,423	504,635
その他未払費用	5,003	7,554
流動負債合計	360,714	542,716
負債合計	360,714	542,716
純資産の部		
元本等		
元本	257,073,979	252,659,583
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	15,351,988	46,219,974
(分配準備積立金)	4,052,087	3,148,340
元本等合計	272,425,967	298,879,557
純資産合計	272,425,967	298,879,557
負債純資産合計	272,786,681	299,422,273

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期中間計算期間 自 2021年12月 1日 至 2022年 5月31日	第3期中間計算期間 自 2022年12月 1日 至 2023年 5月31日
営業収益		
有価証券売買等損益	288,991	33,249,948
営業収益合計	288,991	33,249,948
営業費用		
支払利息	-	113
受託者報酬	9,794	30,527
委託者報酬	162,419	504,635
その他費用	2,364	7,554
営業費用合計	174,577	542,829
営業利益又は営業損失 ()	114,414	32,707,119
経常利益又は経常損失 ()	114,414	32,707,119
中間純利益又は中間純損失 ()	114,414	32,707,119
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 ()	3,654	1,290,540
期首剰余金又は期首欠損金 ()	2,428,653	15,351,988
剰余金増加額又は欠損金減少額	256,655	3,227,463
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	256,655	3,227,463
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,997	3,776,056
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,997	3,776,056
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 ()	2,792,071	46,219,974

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第3期中間計算期間 自 2022年12月1日 至 2023年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

項 目	第2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	257,073,979口	252,659,583口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0597円 (1万口当たりの純資産額10,597円)	1口当たり純資産額 1.1829円 (1万口当たりの純資産額11,829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3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <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>

3. 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る場合、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。
----------------------------	---

(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2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
期首元本額	67,088,151円	257,073,979円
期中追加設定元本額	221,907,962円	62,027,975円
期中一部解約元本額	31,922,134円	66,442,371円

【三井住友D S ・先進国株式インデックス・ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位 : 円)

	第2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年 5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	189	30
コール・ローン	1,163	1,607
親投資信託受益証券	309,573,888	508,180,142
流動資産合計	309,575,240	508,181,779
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	25,267	40,511
未払委託者報酬	518,715	831,335
その他未払費用	7,510	12,073
流動負債合計	551,492	883,919
純資産の部		
元本等		
元本	278,407,177	425,022,055
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	30,616,571	82,275,805
(分配準備積立金)	9,686,410	7,617,703
元本等合計	309,023,748	507,297,860
純資産合計	309,023,748	507,297,860
負債純資産合計	309,575,240	508,181,779

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第2期中間計算期間 自 2021年12月 1日 至 2022年 5月31日	第3期中間計算期間 自 2022年12月 1日 至 2023年 5月31日
営業収益		
有価証券売買等損益	2,768,479	34,120,164
営業収益合計	2,768,479	34,120,164
営業費用		
受託者報酬	12,022	40,511
委託者報酬	247,352	831,335
その他費用	3,526	12,073
営業費用合計	262,900	883,919
営業利益又は営業損失（ ）	2,505,579	33,236,245
経常利益又は経常損失（ ）	2,505,579	33,236,245
中間純利益又は中間純損失（ ）	2,505,579	33,236,245
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（ ）	261,943	2,139,023
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	4,566,401	30,616,571
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,646,206	24,061,859
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	3,646,206	24,061,859
剰余金減少額又は欠損金増加額	354,818	7,777,893
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	354,818	7,777,893
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（ ）	10,101,425	82,275,805

（ 3 ）【中間注記表】

（重要な会計方針の注記）

項 目	第3期中間計算期間 自 2022年12月1日 至 2023年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

（中間貸借対照表に関する注記）

項 目	第2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	278,407,177口	425,022,055口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1100円 (1万口当たりの純資産額11,100円)	1口当たり純資産額 1.1936円 (1万口当たりの純資産額11,936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3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <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>

3. 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。
----------------------------	--

(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2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
期首元本額	70,018,428円	278,407,177円
期中追加設定元本額	270,552,214円	219,098,924円
期中一部解約元本額	62,163,465円	72,484,046円

【三井住友D S ・新興国株式インデックス・ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年 5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	80	22
コール・ローン	494	1,183
親投資信託受益証券	22,536,778	99,036,889
流動資産合計	22,537,352	99,038,094
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	1,839	5,311
未払委託者報酬	38,694	110,098
その他未払費用	575	1,789
流動負債合計	41,108	117,198
負債合計	41,108	117,198
純資産の部		
元本等		
元本	22,559,233	96,520,623
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	62,989	2,400,273
(分配準備積立金)	273,906	218,193
元本等合計	22,496,244	98,920,896
純資産合計	22,496,244	98,920,896
負債純資産合計	22,537,352	99,038,094

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第2期中間計算期間 自 2021年12月 1日 至 2022年 5月31日	第3期中間計算期間 自 2022年12月 1日 至 2023年 5月31日
営業収益		
有価証券売買等損益	140,659	3,026,861
営業収益合計	140,659	3,026,861
営業費用		
受託者報酬	975	5,311
委託者報酬	20,526	110,098
その他費用	286	1,789
営業費用合計	21,787	117,198
営業利益又は営業損失（ ）	162,446	2,909,663
経常利益又は経常損失（ ）	162,446	2,909,663
中間純利益又は中間純損失（ ）	162,446	2,909,663
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（ ）	322	102,930
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	64,352	62,989
剰余金増加額又は欠損金減少額	236,924	44,581
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	44,581
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	236,924	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,359	593,912
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,359	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	593,912
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	137,793	2,400,273

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第3期中間計算期間 自 2022年12月1日 至 2023年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

項 目	第2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	22,559,233口	96,520,623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	<p>元本の欠損</p> <p style="text-align: right;">62,989円</p>	元本の欠損
3. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 0.9972円</p> <p>(1万口当たりの純資産額9,972円)</p>	<p>1口当たり純資産額 1.0249円</p> <p>(1万口当たりの純資産額10,249円)</p>

(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3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>

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

(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2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
期首元本額	2,960,151円	22,559,233円
期中追加設定元本額	29,976,495円	80,987,826円
期中一部解約元本額	10,377,413円	7,026,436円

【三井住友D S ・先進国債インデックス・ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年 5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	89	22
コール・ローン	549	1,168
親投資信託受益証券	80,186,585	291,205,933
流動資産合計	80,187,223	291,207,123
資産合計	80,187,223	291,207,123
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	3,703	19,547
未払委託者報酬	46,809	244,764
その他未払費用	851	4,810
流動負債合計	51,363	269,121
負債合計	51,363	269,121
純資産の部		
元本等		
元本	79,842,763	285,313,094
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	293,097	5,624,908
(分配準備積立金)	472,369	446,368
元本等合計	80,135,860	290,938,002
純資産合計	80,135,860	290,938,002
負債純資産合計	80,187,223	291,207,123

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第2期中間計算期間 自 2021年12月 1日 至 2022年 5月31日	第3期中間計算期間 自 2022年12月 1日 至 2023年 5月31日
営業収益		
有価証券売買等損益	290,712	10,455,318
営業収益合計	290,712	10,455,318
営業費用		
受託者報酬	1,188	19,547
委託者報酬	15,092	244,764
その他費用	243	4,810
営業費用合計	16,523	269,121
営業利益又は営業損失（ ）	307,235	10,186,197
経常利益又は経常損失（ ）	307,235	10,186,197
中間純利益又は中間純損失（ ）	307,235	10,186,197
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（ ）	276,960	85,637
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	25,013	293,097
剰余金増加額又は欠損金減少額	36,970	39,886
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	39,886
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	36,970	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	36,138	4,979,909
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	36,138	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	4,979,909
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	4,430	5,624,908

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第3期中間計算期間	
	自 2022年12月1日 至 2023年5月31日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第2期	第3期中間計算期間
	(2022年11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	79,842,763口	285,313,094口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0037円 (1万口当たりの純資産額10,037円)	1口当たり純資産額 1.0197円 (1万口当たりの純資産額10,197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3期中間計算期間	
	(2023年5月31日現在)	
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <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>	

3. 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。
----------------------------	--

(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2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
期首元本額	6,762,046円	79,842,763円
期中追加設定元本額	86,535,230円	212,544,035円
期中一部解約元本額	13,454,513円	7,073,704円

【三井住友D S ・新興国債インデックス・ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位 : 円)

	第2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年 5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	29,399	3,006
コール・ローン	181,396	162,815
親投資信託受益証券	11,381,577	10,563,501
流動資産合計	11,592,372	10,729,322
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	1,024	1,311
未払委託者報酬	21,590	27,853
その他未払費用	408	303
流動負債合計	23,022	29,467
負債合計	23,022	29,467
純資産の部		
元本等		
元本	12,592,578	11,399,712
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	1,023,228	699,857
(分配準備積立金)	302,215	114,826
元本等合計	11,569,350	10,699,855
純資産合計	11,569,350	10,699,855
負債純資産合計	11,592,372	10,729,322

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第2期中間計算期間 自 2021年12月 1日 至 2022年 5月31日	第3期中間計算期間 自 2022年12月 1日 至 2023年 5月31日
営業収益		
有価証券売買等損益	818,107	396,924
営業収益合計	818,107	396,924
営業費用		
受託者報酬	554	1,311
委託者報酬	11,911	27,853
その他費用	146	303
営業費用合計	12,611	29,467
営業利益又は営業損失（ ）	830,718	367,457
経常利益又は経常損失（ ）	830,718	367,457
中間純利益又は中間純損失（ ）	830,718	367,457
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（ ）	286	24,092
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	13,240	1,023,228
剰余金増加額又は欠損金減少額	35,167	1,115,279
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	1,115,279
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	35,167	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	62	1,183,457
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	62	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	1,183,457
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	808,567	699,857

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第3期中間計算期間 自 2022年12月1日 至 2023年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	12,592,578口	11,399,712口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 1,023,228円	元本の欠損 699,857円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9187円 (1万口当たりの純資産額9,187円)	1口当たり純資産額 0.9386円 (1万口当たりの純資産額9,386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3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>

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

(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2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
期首元本額	1,621,093円	12,592,578円
期中追加設定元本額	10,979,714円	11,321,436円
期中一部解約元本額	8,229円	12,514,302円

【三井住友D S ・国内リートインデックス・ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年 5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	91	21
コール・ローン	565	1,112
親投資信託受益証券	118,143,132	149,373,199
流動資産合計	118,143,788	149,374,332
資産合計	118,143,788	149,374,332
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	4,927	14,454
未払委託者報酬	81,852	239,153
その他未払費用	1,145	3,540
流動負債合計	87,924	257,147
負債合計	87,924	257,147
純資産の部		
元本等		
元本	122,970,950	159,603,818
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	4,915,086	10,486,633
(分配準備積立金)	995,182	958,747
元本等合計	118,055,864	149,117,185
純資産合計	118,055,864	149,117,185
負債純資産合計	118,143,788	149,374,332

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第2期中間計算期間 自 2021年12月 1日 至 2022年 5月31日	第3期中間計算期間 自 2022年12月 1日 至 2023年 5月31日
営業収益		
有価証券売買等損益	464,380	2,496,103
営業収益合計	464,380	2,496,103
営業費用		
支払利息	-	32
受託者報酬	708	14,454
委託者報酬	12,569	239,153
その他費用	61	3,540
営業費用合計	13,338	257,179
営業利益又は営業損失（ ）	477,718	2,753,282
経常利益又は経常損失（ ）	477,718	2,753,282
中間純利益又は中間純損失（ ）	477,718	2,753,282
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（ ）	547,333	181,299
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	109,599	4,915,086
剰余金増加額又は欠損金減少額	369,739	279,407
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	369,739	279,407
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	539,760	3,278,971
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	539,760	3,278,971
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	210,005	10,486,633

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第3期中間計算期間 自 2022年12月1日 至 2023年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

項 目	第2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	122,970,950口	159,603,818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 4,915,086円	元本の欠損 10,486,633円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9600円 (1万口当たりの純資産額9,600円)	1口当たり純資産額 0.9343円 (1万口当たりの純資産額9,343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3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>

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

(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2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
期首元本額	2,251,882円	122,970,950円
期中追加設定元本額	132,574,732円	42,424,624円
期中一部解約元本額	11,855,664円	5,791,756円

【三井住友D S ・先進国リートインデックス・ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位 : 円)

	第2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年 5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	93	22
コール・ローン	571	1,170
親投資信託受益証券	87,051,905	124,179,275
流動資産合計	87,052,569	124,180,467
資産合計	87,052,569	124,180,467
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	5,407	9,592
未払委託者報酬	111,767	197,534
その他未払費用	1,550	2,803
流動負債合計	118,724	209,929
負債合計	118,724	209,929
純資産の部		
元本等		
元本	82,034,605	120,038,137
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	4,899,240	3,932,401
(分配準備積立金)	988,236	683,375
元本等合計	86,933,845	123,970,538
純資産合計	86,933,845	123,970,538
負債純資産合計	87,052,569	124,180,467

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第2期中間計算期間 自 2021年12月 1日 至 2022年 5月31日	第3期中間計算期間 自 2022年12月 1日 至 2023年 5月31日
営業収益		
有価証券売買等損益	313,370	259,270
営業収益合計	313,370	259,270
営業費用		
受託者報酬	978	9,592
委託者報酬	20,986	197,534
その他費用	209	2,803
営業費用合計	22,173	209,929
営業利益又は営業損失（ ）	335,543	49,341
経常利益又は経常損失（ ）	335,543	49,341
中間純利益又は中間純損失（ ）	335,543	49,341
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（ ）	267,035	325,411
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	163,300	4,899,240
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,979,426	856,805
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	1,979,426	856,805
剰余金減少額又は欠損金増加額	754,742	1,547,574
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	754,742	1,547,574
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（ ）	1,319,476	3,932,401

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第3期中間計算期間
	自 2022年12月1日 至 2023年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第2期	第3期中間計算期間
	(2022年11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	82,034,605口	120,038,137口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0597円 (1万口当たりの純資産額10,597円)	1口当たり純資産額 1.0328円 (1万口当たりの純資産額10,328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3期中間計算期間
	(2023年5月31日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <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>

3. 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。
----------------------------	--

(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2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
期首元本額	2,141,454円	82,034,605円
期中追加設定元本額	90,161,002円	65,043,012円
期中一部解約元本額	10,267,851円	27,039,480円

【三井住友D S ・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位 : 円)

	第2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年 5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	14,969	3,124
コール・ローン	92,363	169,199
親投資信託受益証券	334,057,286	684,386,642
派生商品評価勘定	1,316,791	416,575
未収入金	1,069,582	917,765
流動資産合計	336,550,991	685,893,305
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	6,921,973
未払解約金	572,472	-
未払受託者報酬	27,736	52,301
未払委託者報酬	458,109	863,577
その他未払費用	10,342	15,611
流動負債合計	1,068,659	7,853,462
負債合計	1,068,659	7,853,462
純資産の部		
元本等		
元本	361,645,871	676,345,704
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	26,163,539	1,694,139
(分配準備積立金)	-	-
元本等合計	335,482,332	678,039,843
純資産合計	335,482,332	678,039,843
負債純資産合計	336,550,991	685,893,305

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第2期中間計算期間 自 2021年12月 1日 至 2022年 5月31日	第3期中間計算期間 自 2022年12月 1日 至 2023年 5月31日
営業収益		
受取利息	-	1
有価証券売買等損益	9,383,003	59,299,908
為替差損益	11,768,414	31,828,079
営業収益合計	2,385,411	27,471,830
営業費用		
支払利息	-	43
受託者報酬	7,374	52,301
委託者報酬	122,467	863,577
その他費用	2,111	15,611
営業費用合計	131,952	931,532
営業利益又は営業損失（ ）	2,517,363	26,540,298
経常利益又は経常損失（ ）	2,517,363	26,540,298
中間純利益又は中間純損失（ ）	2,517,363	26,540,298
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（ ）	994,489	4,919,484
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	972,728	26,163,539
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,321,170	6,236,864
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	4,010,451
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,321,170	2,226,413
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,489,535	-
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,489,535	-
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（ ）	347,055	1,694,139

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第3期中間計算期間	
	自 2022年12月1日 至 2023年5月31日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 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>	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第2期	第3期中間計算期間
	(2022年11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	361,645,871口	676,345,704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 26,163,539円	元本の欠損
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9277円 (1万口当たりの純資産額9,277円)	1口当たり純資産額 1.0025円 (1万口当たりの純資産額10,025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3期中間計算期間	
	(2023年5月31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（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。
3. 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。

（デリバティブ取引に関する注記）

第2期（2022年11月30日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

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

第3期中間計算期間（2023年5月31日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	41,330,550	-	41,739,600	409,050
	小計	41,330,550	-	41,739,600	409,050
	売建				
	アメリカ・ドル	711,090,151	-	718,004,599	6,914,448
	小計	711,090,151	-	718,004,599	6,914,448
合 計		752,420,701	-	759,744,199	6,505,398

（注）1．時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

項目	第2期 (2022年11月30日現在)	第3期中間計算期間 (2023年5月31日現在)
期首元本額	38,535,757円	361,645,871円
期中追加設定元本額	379,344,235円	403,488,936円
期中一部解約元本額	56,234,121円	88,789,103円

(参考)

「三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド」、「三井住友DS・日経225インデックス・ファンド」、「三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド」、「三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド」、「三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド」、「三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド」、「三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド」、「三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド」および「三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)」は、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」、「225マザーファンド」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「エマージング株式インデックス・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」、「米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド」、「Jリート・インデックス・マザーファンド」、「外国リート・インデックス・マザーファンド」および「ゴールド・インデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、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11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	456,457,514	31,900,278
コール・ローン	2,816,383,083	1,727,717,014
株式	218,143,627,430	239,706,118,000
派生商品評価勘定	205,303,100	176,583,500
未収入金	209,436,600	551,408,184
未収配当金	1,741,212,622	2,520,222,820
差入委託証拠金	186,390,000	172,200,000
流動資産合計	223,758,810,349	244,886,149,796

資産合計	223,758,810,349	244,886,149,796
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	12,306,200
前受金	210,290,000	237,529,000
未払金	124,125,858	83,975,614
未払解約金	605,043,303	324,899,662
その他未払費用	10,581	6,390
流動負債合計	939,469,742	658,716,866
負債合計	939,469,742	658,716,866
純資産の部		
元本等		
元本	65,393,298,021	65,848,946,989
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	157,426,042,586	178,378,485,941
元本等合計	222,819,340,607	244,227,432,930
純資産合計	222,819,340,607	244,227,432,930
負債純資産合計	223,758,810,349	244,886,149,796

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2022年12月1日 至 2023年5月31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</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>

(貸借対照表に関する注記)

項 目	(2022年11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	65,393,298,021口	65,848,946,989口

2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3,4074円 (1万口当たりの純資産額34,074円)	1口当たり純資産額 3,7089円 (1万口当たりの純資産額37,089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5月31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。
3. 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。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

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

(2023年5月31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	4,470,402,700	-	4,634,680,000	164,277,300
	小計	4,470,402,700	-	4,634,680,000	164,277,300
合計		4,470,402,700	-	4,634,680,000	164,277,300

(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。

(その他の注記)

(2022年11月30日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	61,173,269,127円
同期中における追加設定元本額	11,653,465,066円
同期中における一部解約元本額	7,433,436,172円
2022年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,574,760,676円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	1,036,137,254円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,637,683,641円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,605,989,911円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	147,542,223円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	4,234,860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)	19,508,324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)	63,979,125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)	165,870,052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)	149,775,143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)	266,593,539円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,398,015,768円
三井住友・DCつみたてN I S A・日本株インデックスファンド	22,016,808,347円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	179,974,667円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	253,617,658円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	167,938,880円
イオン・バランス戦略ファンド	20,272,782円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	41,931,085円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	191,067,731円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	178,416,019円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	669,872,498円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	375,434,831円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	427,891,807円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	49,851,584円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	813,757,842円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	39,664,361円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	202,349,704円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	191,586,051円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	5,500,206円
日興F W S・日本株インデックス	1,276,658,198円
三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド	18,140,230円
S M A M・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,564,092,115円

バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	11,882,906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 >	74,050,540円
SMAM・バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 >	1,456,182,387円
SMAM・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	1,446,188,375円
SMAM・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	5,623,103,466円
SMAM・バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 >	37,493,396円
SMAM・バランスファンドVL50 < 適格機関投資家限定 >	135,694,110円
SMAM・バランスファンドVA75 < 適格機関投資家専用 >	684,565,549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 >	44,118,775円
SMAM・インデックス・バランスVA25 < 適格機関投資家専用 >	254,234,553円
SMAM・インデックス・バランスVA50 < 適格機関投資家専用 >	796,235,497円
SMAM・バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 >	533,449,238円
SMAM・バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 >	1,657,079,267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 >	36,667,207円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 >	39,482,192円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A < 適格機関投資家専用 >	32,479,210円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A < 適格機関投資家専用 >	16,795,425円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L < 適格機関投資家専用 >	95,429,547円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 >	219,105,114円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2 < 適格機関投資家専用 >	52,522,560円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2 < 適格機関投資家専用 >	38,723,328円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2 < 適格機関投資家専用 >	7,680,964円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2 < 適格機関投資家専用 >	41,326,285円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2 < 適格機関投資家専用 >	542,525,688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)	167,317,059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 >	202,591,112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 >	85,721,825円
SMAM・世界バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 >	94,168,528円
SMAM・世界バランスファンドVA2 < 適格機関投資家限定 >	44,811,453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 >	42,807,427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 >	5,577,900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 >	7,187,543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 >	92,673,351円
SMDAM・日米3資産バランスオープン < 適格機関投資家限定 >	18,136,348円
合計	65,393,298,021円

(2023年5月31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	65,393,298,021円
同期中における追加設定元本額	5,589,967,001円
同期中における一部解約元本額	5,134,318,033円
2023年5月31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	9,567,186,669円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	1,035,647,235円

三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,601,182,134円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,649,411,691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)	143,531,151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)	3,824,083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)	16,754,303円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	59,427,415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)	161,248,195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)	148,660,880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)	267,774,706円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,248,375,843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	24,113,104,157円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	145,148,701円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	199,269,005円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	123,450,488円
イオン・バランス戦略ファンド	48,529,697円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	46,590,437円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	199,377,487円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	187,131,173円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	700,277,235円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	394,498,949円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	455,544,836円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	52,378,195円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	967,956,856円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	40,689,597円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	228,104,464円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	223,888,356円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	6,216,055円
日興F W S・日本株インデックス	1,659,084,279円
三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド	35,232,289円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	45,997円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	52,024円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	62,482円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	74,595円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	74,595円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	34,887円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	50,851円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	61,664円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	71,690円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	81,799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)	2,274,493,308円
バランスファンドV A(安定運用型) <適格機関投資家限定>	10,721,415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>	60,971,681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>	1,185,406,892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>	1,301,469,691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>	4,938,430,674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>	33,895,607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>	121,806,136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>	615,602,816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>	39,924,165円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	213,971,032円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	698,767,712円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	485,970,203円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,443,960,978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>	32,955,479円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	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>	29,039,696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>	82,914,695円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	212,166,342円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	44,449,154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>	7,165,738円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	37,466,256円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	464,356,594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)	155,535,252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>	173,296,382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>	73,144,007円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	69,531,049円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	34,552,675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>	57,902,358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>	49,698,889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>	64,224,712円
SMDAM・日米3資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	15,833,900円
合計	65,848,946,989円

2.2.5 マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2022年11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	368,069,569	42,929,454
コール・ローン	2,271,021,676	2,325,056,466
株式	125,784,079,960	133,984,603,830
派生商品評価勘定	51,424,400	105,340,200
未収入金	-	24,889,000
未収配当金	787,322,520	1,108,192,752
差入委託証拠金	39,102,000	155,940,000
流動資産合計	129,301,020,125	137,746,951,702
資産合計	129,301,020,125	137,746,951,702
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,759,700	27,260,000

前受金	49,720,000	160,590,000
未払解約金	2,826,312	390,243,852
その他未払費用	8,270	5,359
流動負債合計	55,314,282	578,099,211
負債合計	55,314,282	578,099,211
純資産の部		
元本等		
元本	34,776,887,242	32,986,407,062
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	94,468,818,601	104,182,445,429
元本等合計	129,245,705,843	137,168,852,491
純資産合計	129,245,705,843	137,168,852,491
負債純資産合計	129,301,020,125	137,746,951,702

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2022年12月1日 至 2023年5月31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</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>

(貸借対照表に関する注記)

項 目	(2022年11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
1. 担保資産	<p>デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>株式 808,100,000円</p>	
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	34,776,887,242口	32,986,407,062口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.7164円 (1万口当たりの純資産額37,164円)	1口当たり純資産額 4.1583円 (1万口当たりの純資産額41,583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5月31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。
3. 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。

（デリバティブ取引に関する注記）

(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	NK225 先物 0412月	3,400,255,300	-	3,448,920,000	48,664,700
	小計	3,400,255,300	-	3,448,920,000	48,664,700
合計		3,400,255,300	-	3,448,920,000	48,664,700

(2023年5月31日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	NK225 先物 0506月	3,099,469,800	-	3,177,550,000	78,080,200
	小計	3,099,469,800	-	3,177,550,000	78,080,200
合計		3,099,469,800	-	3,177,550,000	78,080,200

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

- 1)原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。
- このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
- 2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

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

(2023年5月31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	34,776,887,242円
同期中における追加設定元本額	6,464,313,150円
同期中における一部解約元本額	8,254,793,330円
2023年5月31日現在の元本の内訳	
三井住友・225オープン	29,683,929,844円
三井住友・DC年金日本株式225ファンド	2,258,628,002円
SMB C・DCインデックスファンド(日経225)	901,470,527円
三井住友DS・日経225インデックス・ファンド	72,005,603円
日本株式225ファンドVA<適格機関投資家専用>	70,373,086円
合計	32,986,407,062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11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	12,344,954,615	4,013,651,232
金銭信託	306,406,160	60,091,244
コール・ローン	1,890,553,005	3,254,537,955
株式	411,677,365,126	487,417,819,287
投資証券	10,072,502,218	10,688,271,086

派生商品評価勘定	487,638,687	97,242,883
未収入金	1,756,879	33,588,201
未収配当金	582,453,884	809,292,868
差入委託証拠金	5,033,061,489	2,406,221,890
流動資産合計	442,396,692,063	508,780,716,646
資産合計	442,396,692,063	508,780,716,646
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	34,123,826	37,839,841
未払金	-	63,857,220
未払解約金	161,000,409	125,861,765
その他未払費用	6,376	3,272
流動負債合計	195,130,611	227,562,098
負債合計	195,130,611	227,562,098
純資産の部		
元本等		
元本	72,186,242,919	76,927,211,095
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	370,015,318,533	431,625,943,453
元本等合計	442,201,561,452	508,553,154,548
純資産合計	442,201,561,452	508,553,154,548
負債純資産合計	442,396,692,063	508,780,716,646

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2022年12月1日 至 2023年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

2. デリバティブの評価基準及び評価方法	(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。 (2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	72,186,242,919口	76,927,211,095口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 6.1258円 (1万口当たりの純資産額61,258円)	1口当たり純資産額 6.6108円 (1万口当たりの純資産額66,108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5月31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。
3. 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。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
	株価指数先物取引 買建 S&P 500 EMINI FUT DEC22	15,697,974,160	-	15,983,395,407	285,421,247

市場取引	SPI 200 FUTURES DEC22	734,736,737	-	757,862,325	23,125,588
	FTSE 100 IDX FUT DEC22	934,911,597	-	963,434,172	28,522,575
	EURO STOXX 50 DEC22	2,969,277,474	-	3,089,695,148	120,417,674
	小計	20,336,899,968	-	20,794,387,052	457,487,084
	合 計	20,336,899,968	-	20,794,387,052	457,487,084

(単位：円)

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

(2023年5月31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	7,834,202,845	-	7,923,805,898	89,603,053
	SPI 200 FUTURES JUN23	363,112,027	-	361,689,059	1,422,968

	FTSE 100 IDX FUT JUN23	469,742,868	-	457,547,225	12,195,643
	EURO STOXX 50 JUN23	1,603,202,907	-	1,598,166,064	5,036,843
	小計	10,270,260,647	-	10,341,208,246	70,947,599
	合計	10,270,260,647	-	10,341,208,246	70,947,599

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	2,258,945,361	-	2,249,414,774	9,530,587
	カナダ・ドル	89,959,118	-	89,424,879	534,239
	オーストラリア・ドル	51,137,854	-	50,804,784	333,070
	イギリス・ポンド	125,624,426	-	125,726,778	102,352
	スイス・フラン	91,591,626	-	91,037,178	554,448
	ユーロ	296,813,374	-	296,118,812	694,562
	小計	2,914,071,759	-	2,902,527,205	11,544,554
	合計	2,914,071,759	-	2,902,527,205	11,544,554

(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。

3)上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額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11月30日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	60,650,874,522円
同期中における追加設定元本額	22,050,143,482円
同期中における一部解約元本額	10,514,775,085円
2022年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	36,369,253,618円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	284,736,068円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	1,090,013,037円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	785,999,194円
S M A M・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	33,400,233円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	1,017,107円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	5,342,658円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）	16,884,192円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）	49,323,143円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）	54,445,231円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）	105,113,958円
外国株式指数ファンド	936,693,371円
三井住友・DCつみたてN I S A・全海外株インデックスファンド	17,542,779,547円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	90,349,697円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	117,821,294円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	75,689,448円
イオン・バランス戦略ファンド	20,982,589円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	21,006,539円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	130,889,105円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	118,201,443円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	437,684,453円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	238,781,337円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	274,840,665円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	54,612,889円
三井住友D S・外国株式インデックス年金ファンド	1,637,991,448円
三井住友D S・年金バランス30（債券重点型）	10,892,390円
三井住友D S・年金バランス50（標準型）	47,697,547円
三井住友D S・年金バランス70（株式重点型）	42,074,552円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,714,893円
S M B C・DCインデックスファンド（M S C Iコクサイ）	397,450,005円
日興F W S・先進国株インデックス（為替ヘッジあり）	250,037,372円
日興F W S・先進国株インデックス（為替ヘッジなし）	1,466,576,467円
三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド	50,536,075円
S M A M・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	449,296,410円
バランスファンドV A（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	3,279,377円
S M A M・バランスファンドV A安定成長型＜適格機関投資家限定＞	20,004,315円
S M A M・バランスファンドV A 2 5＜適格機関投資家専用＞	536,704,870円
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＞	702,957,041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＞	3,074,190,088円

SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	9,972,101円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	49,989,232円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	423,311,736円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	36,093,954円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	90,939,599円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	427,001,205円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	293,567,068円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	687,726,675円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	200,225円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	194,459,687円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	59,953,329円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	7,255,976円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	6,951,628円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	3,833,026円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	17,103,227円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	51,782,752円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	110,286,434円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	46,890,632円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	281,352,925円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	80,381,144円
SMAM・外国株式インデックスファンドSA<適格機関投資家限定>	1,662,845,853円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	17,217,947円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	1,803,118円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	2,321,567円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	74,738,213円
合計	72,186,242,919円

(2023年5月31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	72,186,242,919円
同期中における追加設定元本額	9,859,556,115円
同期中における一部解約元本額	5,118,587,939円
2023年5月31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	38,582,274,413円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	298,331,944円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,134,665,113円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	833,771,125円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	34,543,381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)	938,529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)	4,812,521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)	15,372,068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)	45,120,868円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	54,203,219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)	111,221,632円
外国株式指数ファンド	976,065,483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	19,935,617,916円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	40,690,139円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	93,686,532円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	58,091,459円
イオン・バランス戦略ファンド	27,530,798円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	24,520,121円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	145,661,721円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	129,100,682円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	477,570,781円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	261,237,315円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	305,422,020円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	60,495,916円
三井住友D S・外国株式インデックス年金ファンド	2,041,181,824円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	11,462,726円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	55,745,915円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	50,633,033円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	3,271,256円
S M B C・DCインデックスファンド(M S C Iコクサイ)	686,615,864円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	319,107,510円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	1,964,671,276円
三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド	76,871,202円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	20,612円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	24,584円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	30,826円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	38,462円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	38,462円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	10,556円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	15,546円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	18,945円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	21,986円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	25,027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)	396,913,387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>	3,138,154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>	17,251,454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>	450,615,602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>	660,139,700円
S M A M・バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	2,840,207,442円
S M A M・バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	9,822,476円
S M A M・バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定>	47,046,851円
S M A M・バランスファンドV A 7 5 <適格機関投資家専用>	401,018,478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>	34,829,973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>	82,996,154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>	402,565,881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>	279,468,374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>	628,735,242円
S M A M・バランスV A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・V A S(適格機関投資家専用)	182,897,059円
S M A M・グローバルバランス40V A <適格機関投資家限定>	55,095,802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>	6,575,296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>	16,103,258円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	49,557,783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>	98,602,474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>	41,885,860円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	214,600,360円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	64,044,913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>	874,878,756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>	21,466,696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>	18,041,655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>	23,156,771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>	133,723,760円
合計	76,927,211,095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11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	3,890,895,302	2,102,630,374
金銭信託	31,231,738	1,207,944
コール・ローン	192,702,578	65,422,194
株式	18,551,125,070	24,734,980,146
投資信託受益証券	1,080,935,590	1,397,105,670
投資証券	1,751,546,641	2,348,396,241
派生商品評価勘定	150,967,660	16,046,528
未収入金	-	57,818
未収配当金	34,213,350	54,154,485
差入委託証拠金	977,033,005	873,399,450
流動資産合計	26,660,650,934	31,593,400,850
資産合計	26,660,650,934	31,593,400,850
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	83,196,904	28,080,492
未払解約金	26,843,066	8,268,536
その他未払費用	543	455
流動負債合計	110,040,513	36,349,483
負債合計	110,040,513	36,349,483
純資産の部		
元本等		
元本	16,108,126,428	18,542,842,800
剰余金		

剰余金又は欠損金（ ）	10,442,483,993	13,014,208,567
元本等合計	26,550,610,421	31,557,051,367
純資産合計	26,550,610,421	31,557,051,367
負債純資産合計	26,660,650,934	31,593,400,850

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2022年12月1日 至 2023年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資信託受益証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<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11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	16,108,126,428口	18,542,842,800口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.6483円 (1万口当たりの純資産額16,483円)	1口当たり純資産額 1.7018円 (1万口当たりの純資産額17,018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5月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MSCI EMGMKT DEC22	5,203,165,884	-	5,271,112,198	67,946,314
	小計	5,203,165,884	-	5,271,112,198	67,946,314
合計		5,203,165,884	-	5,271,112,198	67,946,314

(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	262,300,000	-	262,124,442	175,558
	小計	262,300,000	-	262,124,442	175,558
合計		262,300,000	-	262,124,442	175,558

(2023年5月31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	3,183,641,226	-	3,171,604,932	12,036,294
	小計	3,183,641,226	-	3,171,604,932	12,036,294
合計		3,183,641,226	-	3,171,604,932	12,036,294

(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	105,000,000	-	105,002,330	2,330
	小計	105,000,000	-	105,002,330	2,330
合 計		105,000,000	-	105,002,330	2,330

(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。

- 3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額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11月30日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	10,481,267,749円
同期中における追加設定元本額	7,656,711,181円
同期中における一部解約元本額	2,029,852,502円
2022年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	8,414,992,973円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	2,960,029,922円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	183,852,090円

アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	291,047,771円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	194,328,149円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	40,006,969円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	100,172,461円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	75,036,325円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	334,887,158円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	274,169,234円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	448,887,023円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	103,796,383円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	5,268,543円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	706,099,778円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	1,907,693,075円
三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド	13,672,741円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	54,185,833円
合計	16,108,126,428円

(2023年5月31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	16,108,126,428円
同期中における追加設定元本額	3,520,212,913円
同期中における一部解約元本額	1,085,496,541円
2023年5月31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	9,750,140,387円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	3,166,864,973円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	83,189,969円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	244,057,854円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	151,199,837円
イオン・バランス戦略ファンド	140,424,295円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	46,843,931円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	110,736,647円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	82,376,348円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	365,848,809円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	301,605,521円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	506,058,821円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	116,203,423円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	6,224,003円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	850,086,906円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	2,478,120,423円
三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド	58,195,375円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	39,354円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	47,702円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	59,639円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	73,424円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	73,424円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	28,947円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	41,344円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	48,275円

三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）	57,693円
三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル5（積極成長型）	67,186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>	84,128,290円
合 計	18,542,842,800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11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	444,208,536	472,387,916
金銭信託	152,609,385	12,639,051
コール・ローン	941,613,352	684,530,222
国債証券	151,679,008,052	155,215,441,836
未収利息	973,583,208	1,030,775,262
前払費用	46,285,888	59,454,705
流動資産合計	154,237,308,421	157,475,228,992
資産合計	154,237,308,421	157,475,228,992
負債の部		
流動負債		
未払解約金	27,774,541	92,199,311
その他未払費用	3,600	950
流動負債合計	27,778,141	92,200,261
負債合計	27,778,141	92,200,261
純資産の部		
元本等		
元本	77,181,314,549	77,320,552,136
剰余金		
剰余金又は欠損金 ()	77,028,215,731	80,062,476,595
元本等合計	154,209,530,280	157,383,028,731
純資産合計	154,209,530,280	157,383,028,731
負債純資産合計	154,237,308,421	157,475,228,992

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2022年12月1日 至 2023年5月31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</p> <p>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券</p> <p>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<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11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	77,181,314,549口	77,320,552,136口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.9980円 (1万口当たりの純資産額19,980円)	1口当たり純資産額 2.0355円 (1万口当たりの純資産額20,355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5月31日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 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。

(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11月30日現在)
開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	81,104,632,252円
同期中における追加設定元本額	11,875,698,156円
同期中における一部解約元本額	15,799,015,859円
2022年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	25,756,264,406円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	840,993,972円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,169,853,266円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,201,023,285円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	153,754,294円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	6,205,170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)	28,041,920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)	96,060,756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)	254,625,421円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	182,408,320円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	295,713,172円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	22,875,033円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	180,504,559円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	196,065,249円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	127,100,213円
イオン・バランス戦略ファンド	150,083,028円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	24,330,578円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	81,016,637円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	61,389,948円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	162,182,842円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	49,154,614円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	24,004,429円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	167,708,487円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	632,445,610円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	32,709,599円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	98,399,536円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	65,027,461円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	3,130,696円
日興F W S・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	766,936,458円
三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド	40,133,426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>	3,677,884,570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>	5,820,669,217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>	3,997,274,168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>	9,331,565,400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>	30,338,011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>	75,478,804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>	631,815,767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>	109,386,082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>	949,869,564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>	1,336,489,741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>	4,160,020,552円

SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	604,716円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	7,097,718,053円
三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	315,261,191円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	122,294,061円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	67,641,422円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	31,256,873円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,592,229円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	79,935,071円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	365,865,953円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	87,335,608円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	37,410,392円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,460,174円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	898,659,693円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	557,262,211円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	740,186,895円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	424,473,864円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	280,587,013円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	110,869,714円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	14,708,323円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	19,121,369円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	623,061,467円
合計	77,181,314,549円

(2023年5月31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	77,181,314,549円
同期中における追加設定元本額	6,119,505,714円
同期中における一部解約元本額	5,980,268,127円
2023年5月31日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	26,429,145,385円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	927,837,713円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,323,254,511円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,342,566,678円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	163,301,249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)	6,252,899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)	26,830,645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)	97,360,030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)	284,892,741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)	207,820,493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)	330,160,491円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	23,831,780円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	49,557,018円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	74,402,445円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	47,371,586円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	31,136,529円

三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	91,758,592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)	182,716,101円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	55,835,528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NISA・世界分散ファンド	194,723,379円
三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド	804,962,934円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	37,671,051円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	120,492,311円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	83,072,586円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	4,159,681円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	1,023,660,936円
三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド	143,063,588円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	26,867円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	31,324円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	39,141円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	47,947円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	47,947円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	46,616円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	54,445円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	59,419円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	62,438円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	64,457円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	4,415,187,094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>	27,366,360円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	5,172,060,261円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	3,898,391,661円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	9,131,210,461円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	29,825,111円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	71,393,142円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	650,416,907円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	110,475,622円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	939,572,337円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,260,343,854円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,323,429,747円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	4,006,432,759円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	604,716円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	6,869,762,447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)	323,630,431円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	116,969,160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>	30,693,061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>	76,144,588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>	82,408,034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>	859,886,030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>	523,017,070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>	704,490,561円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	343,107,820円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	238,845,058円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	110,487,675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>	88,441,206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>	112,892,679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>	114,752,279円
合計	77,320,552,136円

米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2022年11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	78,573,387	66,988,178
金銭信託	2,587,805	140,723
コール・ローン	15,966,983	7,621,527
国債証券	2,894,688,630	3,657,746,937
派生商品評価勘定	21,511	-
未収利息	25,080,637	39,579,129
前払費用	6,190,809	4,705,565
流動資産合計	3,023,109,762	3,776,782,059
資産合計	3,023,109,762	3,776,782,059
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	2,223,847
その他未払費用	59	34
流動負債合計	59	2,223,881
負債合計	59	2,223,881
純資産の部		
元本等		
元本	3,247,890,526	3,944,271,519
剰余金		
剰余金又は欠損金()	224,780,823	169,713,341
元本等合計	3,023,109,703	3,774,558,178
純資産合計	3,023,109,703	3,774,558,178
負債純資産合計	3,023,109,762	3,776,782,059

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年12月1日 至 2023年5月31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礎となる事項	<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11月30日現在）	（2023年5月31日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	3,247,890,526口	3,944,271,519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	<p>元本の欠損</p> <p>224,780,823円</p>	<p>元本の欠損</p> <p>169,713,341円</p>
3. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 0.9308円</p> <p>（1万口当たりの純資産額9,308円）</p>	<p>1口当たり純資産額 0.9570円</p> <p>（1万口当たりの純資産額9,570円）</p>

（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5月31日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

3. 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。
----------------------------	--

(デリバティブ取引に関する注記)

(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち 1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	9,698,080	-	9,719,591	21,511
	小計	9,698,080	-	9,719,591	21,511
合 計		9,698,080	-	9,719,591	21,511

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(2023年5月31日現在)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(2022年11月30日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	1,047,048,040円
同期中における追加設定元本額	2,892,281,882円
同期中における一部解約元本額	691,439,396円
2022年11月30日現在の元本の内訳	

日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)	391,617,618円
日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)	1,945,147,099円
三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド	12,227,737円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	176,545,209円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	425,820,622円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	296,532,241円
合計	3,247,890,526円

(2023年5月31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	3,247,890,526円
同期中における追加設定元本額	889,795,711円
同期中における一部解約元本額	193,414,718円
2023年5月31日現在の元本の内訳	
日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)	455,624,327円
日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)	2,567,261,224円
三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド	11,038,142円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	175,964,287円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	416,026,038円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	273,900,114円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	38,763,762円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	5,239,330円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	34,762円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	40,409円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	49,379円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	60,552円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	60,552円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	12,291円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	29,950円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	42,472円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	56,019円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	67,909円
合計	3,944,271,519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11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	16,783,253	1,622,173
コール・ローン	103,554,152	87,856,777
投資証券	10,443,009,900	11,503,493,400
派生商品評価勘定	-	1,227,600
未収配当金	61,307,439	75,180,949
前払金	592,000	-

差入委託証拠金	2,300,000	2,220,000
流動資産合計	10,627,546,744	11,671,600,899
資産合計	10,627,546,744	11,671,600,899
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	746,400	-
前受金	-	1,002,000
未払金	60,516,485	37,602,717
未払解約金	2,127,632	2,959,338
その他未払費用	441	269
流動負債合計	63,390,958	41,564,324
負債合計	63,390,958	41,564,324
純資産の部		
元本等		
元本	3,913,179,470	4,416,471,961
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	6,650,976,316	7,213,564,614
元本等合計	10,564,155,786	11,630,036,575
純資産合計	10,564,155,786	11,630,036,575
負債純資産合計	10,627,546,744	11,671,600,899

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2022年12月1日 至 2023年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項 目	(2022年11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
-----	-------------------	------------------

1. 当計算期間の末日における受益権の総数	3,913,179,470口	4,416,471,961口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.6996円 (1万口当たりの純資産額26,996円)	1口当たり純資産額 2.6333円 (1万口当たりの純資産額26,333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5月31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。
3. 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る場合、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。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	リート指数先物取引 買建				
	TREIT先物 0412月	40,146,400	-	39,400,000	746,400
	小計	40,146,400	-	39,400,000	746,400
合計		40,146,400	-	39,400,000	746,400

(2023年5月31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	-	37,610,000	1,227,600
	小計	36,382,400	-	37,610,000	1,227,600

合計	36,382,400	-	37,610,000	1,227,600
----	------------	---	------------	-----------

(注) 1. 時価の算定方法

リート指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2)リート指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(2022年11月30日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	3,284,744,165円
同期中における追加設定元本額	2,347,844,703円
同期中における一部解約元本額	1,719,409,398円
2022年11月30日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	123,734,117円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	226,924,020円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	145,809,464円
イオン・バランス戦略ファンド	20,352,708円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	2,243,436,891円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	18,736,291円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	60,011,376円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	46,032,543円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	162,453,627円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	92,074,182円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	72,660,790円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	30,209,555円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,455,740円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	167,299,338円
日興FWS・Jリートインデックス	374,896,546円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	43,763,199円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	3,324,665円
SMAM・年金WRリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	28,778,069円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	3,208,159円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	4,273,982円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%)<適格機関投資家限定>	42,744,208円
合計	3,913,179,470円

(2023年5月31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	3,913,179,470円
同期中における追加設定元本額	1,300,815,031円

同期中における一部解約元本額	797,522,540円
2023年5月31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)	66,281,427円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	109,362,961円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	95,579,663円
イオン・バランス戦略ファンド	44,262,348円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	2,438,247,172円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	17,584,270円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	70,705,563円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	53,980,201円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	190,138,469円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	109,210,593円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	85,936,082円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	37,427,523円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,373,419円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	209,068,192円
日興FWS・Jリートインデックス	498,270,984円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	56,724,718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	12,774円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	19,339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
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	11,008円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	24,086円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	32,318円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	40,162円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	48,935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WRリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	56,934,013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>	53,871,731円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	68,587,736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>	148,368,883円
合計	4,416,471,961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11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	179,631,581	154,140,049
金銭信託	25,566,164	760,929
コール・ローン	157,745,488	41,211,889

投資証券	24,586,639,159	26,803,867,926
派生商品評価勘定	1,047	135
未収入金	1,170,969	1,099,040
未収配当金	39,192,137	39,521,077
流動資産合計	24,989,946,545	27,040,601,045
資産合計	24,989,946,545	27,040,601,045
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	170,425	162,581
未払金	78,556,684	-
未払解約金	31,589,177	3,000,000
その他未払費用	371	125
流動負債合計	110,316,657	3,162,706
負債合計	110,316,657	3,162,706
純資産の部		
元本等		
元本	8,860,732,746	9,841,825,258
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	16,018,897,142	17,195,613,081
元本等合計	24,879,629,888	27,037,438,339
純資産合計	24,879,629,888	27,037,438,339
負債純資産合計	24,989,946,545	27,040,601,045

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年12月1日 至 2023年5月31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</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礎となる事項	<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11月30日現在）	（2023年5月31日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	8,860,732,746口	9,841,825,258口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.8079円 （1万口当たりの純資産額28,079円）	1口当たり純資産額 2.7472円 （1万口当たりの純資産額27,472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5月31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。
3. 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る場合、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。

（デリバティブ取引に関する注記）

（2022年11月30日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	130,100,000	-	130,003,672	96,328
	オーストラリア・ドル	14,300,000	-	14,243,620	56,380
	シンガポール・ドル	2,300,000	-	2,300,972	972
	イギリス・ポンド	1,800,000	-	1,782,358	17,642
	小計	148,500,000	-	148,330,622	169,378
合計		148,500,000	-	148,330,622	169,378

（2023年5月31日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	29,900,000	-	29,737,554	162,446
	小計	29,900,000	-	29,737,554	162,446
合 計		29,900,000	-	29,737,554	162,446

(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。

- 3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額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11月30日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	6,336,539,299円
同期中における追加設定元本額	3,494,346,976円
同期中における一部解約元本額	970,153,529円
2022年11月30日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	12,940,527円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	17,073,331円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	12,567,990円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	7,380,775,925円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	6,434,883円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	58,606,602円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	44,014,413円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	153,929,966円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	87,821,388円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	69,286,976円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	89,559,984円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	845,457円

三井住友D S・外国リートインデックス年金ファンド	325,259,559円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	78,592,105円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	387,230,766円
三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド	31,002,495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>	36,000,406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>	31,377,238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>	37,412,735円
合 計	8,860,732,746円

(2023年5月31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	8,860,732,746円
同期中における追加設定元本額	1,392,976,882円
同期中における一部解約元本額	411,884,370円
2023年5月31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)	13,398,410円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	17,518,661円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	11,017,650円
イオン・バランス戦略ファンド	104,984,034円
三井住友・D C外国リートインデックスファンド	7,903,607,639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	7,808,383円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	67,747,695円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	50,706,295円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	178,973,156円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	103,596,659円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	82,343,925円
三井住友・D CつみたてN I S A・世界分散ファンド	107,329,841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	1,034,851円
三井住友D S・外国リートインデックス年金ファンド	361,893,166円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	97,179,330円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	515,053,046円
三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド	45,202,124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
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	2,761円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	4,369円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	5,602円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	6,885円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	7,844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>	38,360,696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>	98,272,324円

合 計

9,841,825,258円

ゴールド・インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位 : 円)

	(2022年11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	44,944,694	38,837,473
金銭信託	4,242,207	775,566
コール・ローン	26,174,794	42,004,616
投資信託受益証券	3,754,431,327	5,489,106,870
派生商品評価勘定	1,728	1,301
流動資産合計	3,829,794,750	5,570,725,826
資産合計	3,829,794,750	5,570,725,826
負債の部		
流動負債		
未払金	53,523,970	36,956,586
未払解約金	1,069,582	917,765
その他未払費用	122	125
流動負債合計	54,593,674	37,874,476
負債合計	54,593,674	37,874,476
純資産の部		
元本等		
元本	3,178,413,029	4,141,921,122
剰余金		
剰余金又は欠損金 ()	596,788,047	1,390,930,228
元本等合計	3,775,201,076	5,532,851,350
純資産合計	3,775,201,076	5,532,851,350
負債純資産合計	3,829,794,750	5,570,725,826

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2022年12月1日 至 2023年5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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>

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年11月30日現在)	(2023年5月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	3,178,413,029口	4,141,921,122口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1878円 (1万口当たりの純資産額11,878円)	1口当たり純資産額 1.3358円 (1万口当たりの純資産額13,358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5月31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。
3. 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。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	39,987,446	-	39,989,174	1,728
	小計	39,987,446	-	39,989,174	1,728

合 計	39,987,446	-	39,989,174	1,728
-----	------------	---	------------	-------

(2023年5月31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	27,529,055	-	27,530,356	1,301
	小計	27,529,055	-	27,530,356	1,301
合 計		27,529,055	-	27,530,356	1,301

(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。

3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額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11月30日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	864,264,346円
同期中における追加設定元本額	2,632,159,819円
同期中における一部解約元本額	318,011,136円
2022年11月30日現在の元本の内訳	
日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)	316,496,322円
日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)	2,580,676,358円
三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)	281,240,349円
合 計	3,178,413,029円

(2023年5月31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	3,178,413,029円
同期中における追加設定元本額	1,151,382,766円
同期中における一部解約元本額	187,874,673円
2023年5月31日現在の元本の内訳	
日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)	362,611,697円
日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)	3,266,684,024円
三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)	512,342,149円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	25,537円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	46,487円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	62,044円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	70,666円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	78,518円
合計	4,141,921,122円

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

2023年6月30日現在

資産総額	169,921,723円
負債総額	51,086円
純資産総額(-)	169,870,637円
発行済口数	134,371,355口
1口当たり純資産額(/) (1万口当たり純資産額)	1.2642円 (12,642円)

三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

2023年6月30日現在

資産総額	338,390,423円
負債総額	103,318円
純資産総額(-)	338,287,105円
発行済口数	265,873,085口
1口当たり純資産額(/) (1万口当たり純資産額)	1.2724円 (12,724円)

三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド

2023年6月30日現在

資産総額	572,942,173円
負債総額	213,372円
純資産総額(-)	572,728,801円
発行済口数	445,017,492口
1口当たり純資産額(/) (1万口当たり純資産額)	1.2870円 (12,870円)

三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド

2023年6月30日現在

資産総額	106,859,556円
負債総額	41,094円
純資産総額(-)	106,818,462円
発行済口数	98,281,070口
1口当たり純資産額(/) (1万口当たり純資産額)	1.0869円 (10,869円)

三井住友D S ・先進国債インデックス・ファンド

2023年6月30日現在

資産総額	313,993,150円
負債総額	74,006円
純資産総額（ - ）	313,919,144円
発行済口数	296,189,402口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	1.0599円 (10,599円)

三井住友D S ・新興国債インデックス・ファンド

2023年6月30日現在

資産総額	11,234,940円
負債総額	4,554円
純資産総額（ - ）	11,230,386円
発行済口数	11,450,635口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	0.9808円 (9,808円)

三井住友D S ・国内リートインデックス・ファンド

2023年6月30日現在

資産総額	150,444,865円
負債総額	47,704円
純資産総額（ - ）	150,397,161円
発行済口数	162,006,336口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	0.9283円 (9,283円)

三井住友D S ・先進国リートインデックス・ファンド

2023年6月30日現在

資産総額	340,125,051円
負債総額	98,395円
純資産総額（ - ）	340,026,656円
発行済口数	307,415,505口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	1.1061円 (11,061円)

三井住友D S ・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）

2023年6月30日現在

資産総額	733,456,574円
負債総額	16,909,334円

純資産総額（ - ）	716,547,240円
発行済口数	737,915,771口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	0.9710円 （9,710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6月30日現在
資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060株

ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

ハ 会社の機構

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

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

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

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

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6月30日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	704	10,457,929
単位型株式投資信託	96	573,616
追加型公社債投資信託	1	25,933
単位型公社債投資信託	171	279,100
合計	972	11,336,579

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。
- 2 当社は、当事業年度（2022年4月1日から2023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ます。

（1）【貸借対照表】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	49,008,279	37,742,400
金銭の信託	-	12,645,575
顧客分別金信託	300,041	300,046
前払費用	475,266	546,900
未収入金	103,809	437,880
未収委託者報酬	12,125,117	11,563,662
未収運用受託報酬	2,437,063	2,138,030
未収投資助言報酬	388,639	344,586
未収収益	36,700	35,477
その他の流動資産	18,458	8,423
流動資産合計	64,893,375	65,762,982
固定資産		
有形固定資産	1	
建物	1,433,442	1,361,305
器具備品	653,985	559,057
土地	710	710

リース資産	7,357	4,114
建設仮勘定	5,500	81,240
有形固定資産合計	2,100,996	2,006,427
無形固定資産		
ソフトウェア	2,766,476	2,414,295
ソフトウェア仮勘定	100,616	508,956
のれん	3,349,950	3,045,409
顧客関連資産	13,558,615	11,445,340
電話加入権	12,716	12,706
商標権	42	36
無形固定資産合計	19,788,417	17,426,744
投資その他の資産		
投資有価証券	14,212,354	9,222,276
関係会社株式	11,246,398	11,850,598
長期差入保証金	1,414,646	1,388,987
長期前払費用	77,936	80,207
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	27,021,065	22,611,799
固定資産合計	48,910,479	42,044,971
資産合計	113,803,855	107,807,953

(単位：千円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
負債の部		
流動負債		
リース債務	3,567	2,564
顧客からの預り金	6,045	11,094
その他の預り金	196,515	128,069
未払金		
未払収益分配金	1,969	2,013
未払償還金	152	1,312
未払手数料	5,545,582	5,194,011
その他未払金	48,893	259,542
未払費用	7,379,404	6,370,986
未払消費税等	1,133,332	406,770
未払法人税等	2,455,291	333,009
賞与引当金	2,100,323	1,801,492
資産除去債務	7,192	13,940
その他の流動負債	40,396	73,657
流動負債合計	18,918,667	14,598,465
固定負債		
リース債務	4,525	1,960
繰延税金負債	1,279,409	550,493
退職給付引当金	5,084,506	5,027,832
その他の固定負債	4,620	-
固定負債合計	6,373,062	5,580,287
負債合計	25,291,730	20,178,752
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	73,466,962	73,466,962
資本剰余金合計	82,095,946	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		
繰越利益剰余金	3,834,794	3,391,568
利益剰余金合計	4,119,040	3,675,814
株主資本計	88,214,986	87,771,760
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	297,138	142,558
評価・換算差額等合計	297,138	142,558
純資産合計	88,512,124	87,629,201
負債・純資産合計	113,803,855	107,807,953

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自	2021年4月1日	(自	2022年4月1日
	至	2022年3月31日)	至	2023年3月31日)
営業収益				
委託者報酬		66,139,024		61,471,271
運用受託報酬		9,652,634		8,978,419
投資助言報酬		1,256,334		1,273,386
その他営業収益				
サービス支援手数料		199,046		208,222
その他		32,936		22,995
営業収益計		77,279,976		71,954,296
営業費用				
支払手数料		30,522,133		28,036,456
広告宣伝費		330,161		294,588
調査費				
調査費		3,196,921		3,749,357
委託調査費		12,192,048		11,455,987
営業雑経費				
通信費		67,600		61,068
印刷費		494,834		452,951
協会費		34,433		38,701
諸会費		30,488		33,447
情報機器関連費		4,767,504		5,067,617
販売促進費		31,930		29,621
その他		181,301		197,696
営業費用合計		51,849,358		49,417,495
一般管理費				
給料				
役員報酬		263,893		219,872
給料・手当		8,664,828		7,807,797
賞与		991,916		1,042,472
賞与引当金繰入額		2,100,323		1,798,492
交際費		12,301		27,713
寄付金		29,273		25,518
事務委託費		1,422,189		1,727,189
旅費交通費		16,863		99,733
租税公課		476,729		352,030

不動産賃借料	1,289,256	1,268,303
退職給付費用	632,559	624,551
固定資産減価償却費	3,133,951	3,247,869
のれん償却費	304,540	304,540
諸経費	256,994	200,758
一般管理費合計	19,595,622	18,746,845
営業利益	5,834,995	3,789,956

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	7,666	1,755
受取利息	1,836	1,373
時効成立分配金・償還金	43,406	521
原稿・講演料	2,587	2,281
投資有価証券償還益	383,608	119,033
投資有価証券売却益	911,268	25,848
為替差益	4,673	5,816
雑収入	81,640	91,814
営業外収益合計	1,436,686	248,443
営業外費用		
金銭の信託運用損	-	454,339
投資有価証券償還損	146,219	83,598
投資有価証券売却損	81,384	152,691
雑損失	2,866	-
営業外費用合計	230,470	690,629
経常利益	7,041,212	3,347,770
特別損失		
1 固定資産除却損	83,651	13,203
2 システム統合関連費用	375,636	-
3 早期退職費用	260,075	126,832
4 支払補償費	-	30,075
その他特別損失	67,000	-
特別損失合計	786,362	170,111
税引前当期純利益	6,254,849	3,177,659
法人税、住民税及び事業税	3,101,482	1,622,064
法人税等調整額	965,673	541,433
法人税等合計	2,135,809	1,080,631
当期純利益	4,119,040	2,097,028

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本	
	資本剰余金	利益剰余金

	資本金	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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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 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
当期変動額						
剰余金の配当						2,540,254
当期純利益						2,097,028
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	443,225
当期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	3,391,568

	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
当期変動額					
剰余金の配当	2,540,254	2,540,254			2,540,254
当期純利益	2,097,028	2,097,028			2,097,028
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）			439,697	439,697	439,697
当期変動額合計	443,225	443,225	439,697	439,697	882,923
当期末残高	3,675,814	87,771,760	142,558	142,558	87,629,201

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 重要な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

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) 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

(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

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。）等を当事業年度の期首から適用し、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。これによる当事業年度の財務諸表に与える影響はありません。なお、時価算定会計基準適用指針27-3項に定める経過的な取扱いに従って、前事業年度に係る「金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項」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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
建物	210,548千円	301,463千円
器具備品	1,309,352千円	1,499,284千円
リース資産	6,073千円	7,493千円

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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
Sumitomo Mitsui DS Asset Management (USA) Inc.	57,356千円	12,514千円

(損益計算書関係)

1 固定資産除却損

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
建物	- 千円	2,482千円
器具備品	0千円	4,273千円
リース資産	- 千円	532千円
ソフトウェア	83,651千円	5,915千円

2 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。

3 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。

4 支払補償費

受益者や販売会社に生じた損失の補償に伴い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 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. 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

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023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
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

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
2023年6月28日 定時株主総会	普通株式	1,591,892	47.00	2023年 3月31日	2023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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
1年以内	1,166,952	1,161,545
1年超	2,323,090	1,161,545
合計	3,490,042	2,323,090

(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おり、当社が設定する投資信託の事業推進等を目的として、直接または特定金外信託を通じて当該投資信託を保有しております。特定金外信託を通じ行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託にかかる将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、投資信託保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

なお、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。

金銭の信託及び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。

金銭の信託、投資有価証券及び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

金銭の信託及び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。

また、特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、市場価格の変動リスクについて為替予約、株価指数先物、債券先物、スワップ取引などのデリバティブ取引により一部リスクヘッジしております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

当事業年度における貸借対照表計上額、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。

前事業年度（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) 金銭の信託	-	-	-
(2) 投資有価証券 その他有価証券	14,172,545	14,172,545	-
資産計	14,172,545	14,172,545	-

当事業年度（2023年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 金銭の信託	12,645,575	12,645,575	-
(2) 投資有価証券 その他有価証券	9,182,466	9,182,466	-
資産計	21,828,042	21,828,042	-

(注1) 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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
其他有価証券 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	11,850,598
合計	11,246,398	11,850,598

3. 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。なお、時価算定会計基準適用指針27-3項に定める経過的な取扱いに従って、前事業年度に係る「金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項」については記載しておりません。

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	-	12,645,575	-	12,645,575
(2) 投資有価証券 其他有価証券	-	9,182,466	-	9,182,466
資産計	-	21,828,042	-	21,828,042

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 其他有価証券

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)

1. 子会社株式

前事業年度（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。

当事業年度（2023年3月31日）

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

2. 其他有価証券

前事業年度（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。

当事業年度(2023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	3,144,004	3,054,367	89,637
小計	3,144,004	3,054,367	89,637
(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	6,038,462	6,295,278	256,815
小計	6,038,462	6,295,278	256,815
合計	9,182,466	9,349,645	167,178

(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 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

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023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
1,675,637	25,848	152,691

(単位:千円)

償還額	償還益の合計額	償還損の合計額
6,449,143	119,033	83,598

(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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
退職給付債務の期首残高	5,258,448	5,084,506
勤務費用	454,611	429,188
利息費用	1,013	6,502
数理計算上の差異の発生額	34,553	12,781
退職給付の支払額	595,013	479,583
過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	5,084,506	5,027,832

(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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	5,084,506	5,027,832
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	5,084,506	5,027,832

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
勤務費用	454,611	429,188
利息費用	1,013	6,502
数理計算上の差異の費用処理額	34,553	12,781
その他	211,487	201,641
確定給付制度に係る退職給付費用	632,559	624,551

(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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
割引率	0.130%	0.230%

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237,296千円、当事業年度241,556千円であります。

(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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	1,556,876	1,539,522
賞与引当金	643,119	551,617
調査費	279,809	473,972
未払金	284,070	211,439
未払事業税	139,522	39,995
ソフトウェア償却	107,998	105,506
子会社株式評価損	114,876	114,876
その他有価証券評価差額金	93,946	120,350
その他	28,056	21,158
繰延税金資産小計	3,248,274	3,178,439
評価性引当額	189,102	193,662
繰延税金資産合計	3,059,171	2,984,776
繰延税金負債		
無形固定資産	4,151,648	3,504,563
資産除去債務	825	3,201
その他有価証券評価差額金	186,107	27,506
繰延税金負債合計	4,338,581	3,535,270
繰延税金資産（負債）の純額	1,279,409	550,493

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 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
法定実効税率	30.6%	30.6%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.6	3.0
のれん償却費	1.4	2.9
所得税額控除による税額控除	-	1.3

その他	0.3	1.2
税効果会計適用後の法人税等の負担率	34.1	34.0

(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 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。

当事業年度(自 2022年4月1日 至2023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	61,471,271	8,978,419	1,273,386	231,218	71,954,296

(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 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）

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023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	5,279,199	未払 手数料	1,265,651
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	7,030,381	未払 手数料	1,288,749

(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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり純資産額	2,613.28円	2,587.21円
1株当たり当期純利益	121.61円	61.91円

(注) 1. 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の算定上の基礎は、次のとおりであります。

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり当期純利益		
当期純利益(千円)	4,119,040	2,097,028
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(千円)	4,119,040	2,097,028
期中平均株式数(株)	33,870,060	33,870,060

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）
- (ハ) 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。

ロ 販売会社

名称	資本金の額（百万円） 2022年3月末現在	事業の内容
S M B C 日興証券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

ロ 販売会社

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

3【資本関係】

（持株比率5%以上を記載しています。）
該当事項はありません。

第3【その他】

1 目論見書の表紙から本文の前までおよび裏表紙の記載について

- (1) 「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨を記載することがあります。
- (2) 委託会社の金融商品取引業者登録番号を記載することがあります。
- (3) 委託会社のホームページのアドレスおよび他のインターネットのアドレス（これらのアドレスをコード化した図形等も含む）を記載することがあります。
- (4) 請求目論見書の入手方法および投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨を記載することがあります。
- (5) 目論見書の使用開始日を記載することがあります。
- (6) 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。
- (7) 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨を記載することがあります。

- (8) 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載をすることがあります。
 - (9) 当ファンドのロゴおよび委託会社のロゴを記載することがあります。
 - (10) ファンドの形態および属性、申込みにかかる事項、ユニバーサルデザインフォントマークを記載することがあります。
 - (11) 写真、イラスト、図案およびキャッチコピーを採用することがあります。また、ファンドの管理番号等を記載することがあります。
- 2 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。
 - 3 当ファンドの投資信託約款の全文を請求目論見書に掲載することがあります。
 - 4 目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書(交付目論見書)」または「投資信託説明書(請求目論見書)」と称して使用することがあります。
 - 5 評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。
 - 6 有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドの実質的な投資対象資産に共通性がある場合には、当該複数のファンドを一つの投資信託説明書(交付目論見書)で説明することがあります。また、有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドにかかる投資信託説明書(交付目論見書)および投資信託説明書(請求目論見書)を一体のものとして使用することがあります。

独立監査人の監査報告書

2023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

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2023年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。

2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2023年2月7日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンドの2021年12月1日から2022年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンドの2022年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

独立監査人の監査報告書

2023年2月7日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・日経225インデックス・ファンドの2021年12月1日から2022年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・日経225インデックス・ファンドの2022年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表

示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2023年2月7日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンドの2021年12月1日から2022年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンドの2022年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表

示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2023年2月7日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンドの2021年12月1日から2022年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンドの2022年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表

示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2023年2月7日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	菅野 雅子
--------------------	-------	-------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	松井 貴志
--------------------	-------	-------

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・先進国債インデックス・ファンドの2021年12月1日から2022年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・先進国債インデックス・ファンドの2022年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表

示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2023年2月7日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 石井 勝也指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐藤 栄裕**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・新興国債インデックス・ファンドの2021年12月1日から2022年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・新興国債インデックス・ファンドの2022年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表

示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2023年2月7日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	菅野 雅子
--------------------	-------	-------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	松井 貴志
--------------------	-------	-------

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・国内リートインデックス・ファンドの2021年12月1日から2022年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・国内リートインデックス・ファンドの2022年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表

示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2023年2月7日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	菅野 雅子
--------------------	-------	-------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	松井 貴志
--------------------	-------	-------

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンドの2021年12月1日から2022年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンドの2022年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表

示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2023年2月7日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	石井 勝也
--------------------	-------	-------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	佐藤 栄裕
--------------------	-------	-------

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）の2021年12月1日から2022年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）の2022年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し

適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。 2 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年8月16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

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

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DS・TOPIXインデックス・ファンドの2022年12月1日から2023年5月31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DS・TOPIXインデックス・ファンドの2023年5月31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12月1日から2023年5月31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。

その他の事項

ファンドの2022年11月30日をもって終了した前計算期間の中間計算期間に係る中間財務諸表及び前計算期間の財務諸表は、それぞれ、前任監査人によって中間監査及び監査が実施されている。前任監査人は、当該中間財務諸表に対して2022年8月16日付けで有用な情報を表示している旨の意見を表明しており、また、当該財務諸表に対して2023年2月7日付けで無限定適正意見を表明している。

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、継続企業の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. XBRL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8月16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

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

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DS・日経225インデックス・ファンドの2022年12月1日から2023年5月31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DS・日経225インデックス・ファンドの2023年5月31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12月1日から2023年5月31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。

その他の事項

ファンドの2022年11月30日をもって終了した前計算期間の中間計算期間に係る中間財務諸表及び前計算期間の財務諸表は、それぞれ、前任監査人によって中間監査及び監査が実施されている。前任監査人は、当該中間財務諸表に対して2022年8月16日付けで有用な情報を表示している旨の意見を表明しており、また、当該財務諸表に対して2023年2月7日付けで無限定適正意見を表明している。

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、継続企業の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. XBRL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8月16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

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

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DS・先進国株式インデックス・ファンドの2022年12月1日から2023年5月31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DS・先進国株式インデックス・ファンドの2023年5月31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12月1日から2023年5月31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。

その他の事項

ファンドの2022年11月30日をもって終了した前計算期間の中間計算期間に係る中間財務諸表及び前計算期間の財務諸表は、それぞれ、前任監査人によって中間監査及び監査が実施されている。前任監査人は、当該中間財務諸表に対して2022年8月16日付けで有用な情報を表示している旨の意見を表明しており、また、当該財務諸表に対して2023年2月7日付けで無限定適正意見を表明している。

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、継続企業の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. XBRL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8月16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

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

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DS・新興国株式インデックス・ファンドの2022年12月1日から2023年5月31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DS・新興国株式インデックス・ファンドの2023年5月31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12月1日から2023年5月31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。

その他の事項

ファンドの2022年11月30日をもって終了した前計算期間の中間計算期間に係る中間財務諸表及び前計算期間の財務諸表は、それぞれ、前任監査人によって中間監査及び監査が実施されている。前任監査人は、当該中間財務諸表に対して2022年8月16日付けで有用な情報を表示している旨の意見を表明しており、また、当該財務諸表に対して2023年2月7日付けで無限定適正意見を表明している。

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、継続企業の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. XBRL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8月16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

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

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DS・先進国債インデックス・ファンドの2022年12月1日から2023年5月31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DS・先進国債インデックス・ファンドの2023年5月31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12月1日から2023年5月31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。

その他の事項

ファンドの2022年11月30日をもって終了した前計算期間の中間計算期間に係る中間財務諸表及び前計算期間の財務諸表は、それぞれ、前任監査人によって中間監査及び監査が実施されている。前任監査人は、当該中間財務諸表に対して2022年8月16日付けで有用な情報を表示している旨の意見を表明しており、また、当該財務諸表に対して2023年2月7日付けで無限定適正意見を表明している。

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、継続企業の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. XBRL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8月16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

PwC あらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

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DS・新興国債インデックス・ファンドの2022年12月1日から2023年5月31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DS・新興国債インデックス・ファンドの2023年5月31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12月1日から2023年5月31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。

その他の事項

ファンドの2022年11月30日をもって終了した前計算期間の中間計算期間に係る中間財務諸表及び前計算期間の財務諸表は、それぞれ、前任監査人によって中間監査及び監査が実施されている。前任監査人は、当該中間財務諸表に対して2022年8月16日付けで有用な情報を表示している旨の意見を表明しており、また、当該財務諸表に対して2023年2月7日付けで無限定適正意見を表明している。

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、継続企業の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. XBRL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8月16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

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

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DS・国内リートインデックス・ファンドの2022年12月1日から2023年5月31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DS・国内リートインデックス・ファンドの2023年5月31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12月1日から2023年5月31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。

その他の事項

ファンドの2022年11月30日をもって終了した前計算期間の中間計算期間に係る中間財務諸表及び前計算期間の財務諸表は、それぞれ、前任監査人によって中間監査及び監査が実施されている。前任監査人は、当該中間財務諸表に対して2022年8月16日付けで有用な情報を表示している旨の意見を表明しており、また、当該財務諸表に対して2023年2月7日付けで無限定適正意見を表明している。

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、継続企業の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に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. XBRL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8月16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

PwC あらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

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DS・先進国リートインデックス・ファンドの2022年12月1日から2023年5月31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DS・先進国リートインデックス・ファンドの2023年5月31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12月1日から2023年5月31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。

その他の事項

ファンドの2022年11月30日をもって終了した前計算期間の中間計算期間に係る中間財務諸表及び前計算期間の財務諸表は、それぞれ、前任監査人によって中間監査及び監査が実施されている。前任監査人は、当該中間財務諸表に対して2022年8月16日付けで有用な情報を表示している旨の意見を表明しており、また、当該財務諸表に対して2023年2月7日付けで無限定適正意見を表明している。

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、継続企業の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に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. XBRL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8月16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

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

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DS・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）の2022年12月1日から2023年5月31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DS・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）の2023年5月31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12月1日から2023年5月31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。

その他の事項

ファンドの2022年11月30日をもって終了した前計算期間の中間計算期間に係る中間財務諸表及び前計算期間の財務諸表は、それぞれ、前任監査人によって中間監査及び監査が実施されている。前任監査人は、当該中間財務諸表に対して2022年8月16日付けで有用な情報を表示している旨の意見を表明しており、また、当該財務諸表に対して2023年2月7日付けで無限定適正意見を表明している。

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、継続企業の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. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。