

【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】	2024年1月23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】	イオン・バランス戦略ファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	2,500億円を上限とします。
【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】

イオン・バランス戦略ファンド

(愛称として「みらいパレット」という名称を用いることがあります。)

以下「当ファンド」といいます。

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

* ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社である三井住友DS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】

2,500億円を上限とします。

(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、「みらいパレ」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	コールセンター	ホームページ
三井住友DSアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	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、1.76%（税抜き1.6%）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。

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】

2024年1月24日から2024年7月23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。

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

イ 申込証拠金

ありません。

ロ 日本以外の地域における募集

ありません。

ハ お申込不可日

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

・ニューヨークの取引所の休業日

・ロンドンの取引所の休業日

・ニューヨークの銀行の休業日

・ロンドンの銀行の休業日

ニ クーリング・オフ制度(金融商品取引法第37条の6)の適用
ありません。

ホ 振替受益権について

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

(参考：投資信託振替制度)

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

イ 当ファンドは、主として、安定資産ポートフォリオならびにリスク資産ポートフォリオを構成する投資信託証券への投資を通じて、下方リスクを抑制しつつ、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

ロ 委託会社は、受託会社と合意の上、金500億円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。

ハ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

（イ）当ファンドが該当する商品分類

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

（ロ）当ファンドが該当する属性区分

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を含む)		
	年2回	日本		
	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 (部分ヘッジ)
	年12回(毎月)	アジア		
	日々	オセアニア		
	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし
		アフリカ		
その他資産 (投資信託証券(資産複合(株式、債券、不動産投信)資産配分変更型))		中近東(中東)		
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング		

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

(2) 【ファンドの沿革】

2016年10月12日

信託契約締結、設定、運用開始。

2017年 5月29日

信託期間の変更(無期限化)実施。

(3) 【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(イ) 委託会社 「三井住友D Sアセットマネジメント株式会社」

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

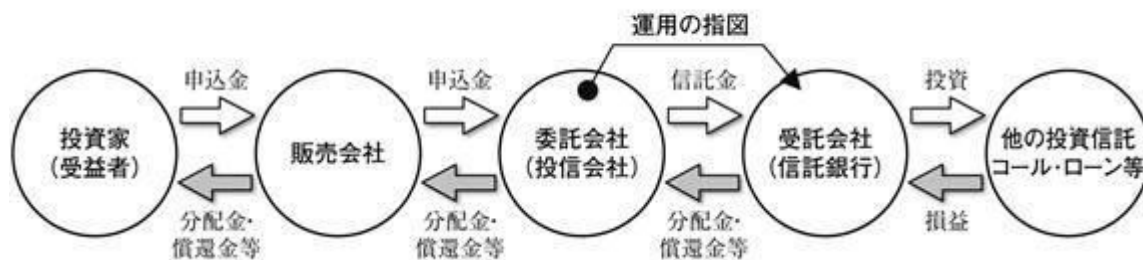
(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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

(ハ) 販売会社

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

運営の仕組み



ロ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

20億円（2023年11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11月30日現在)

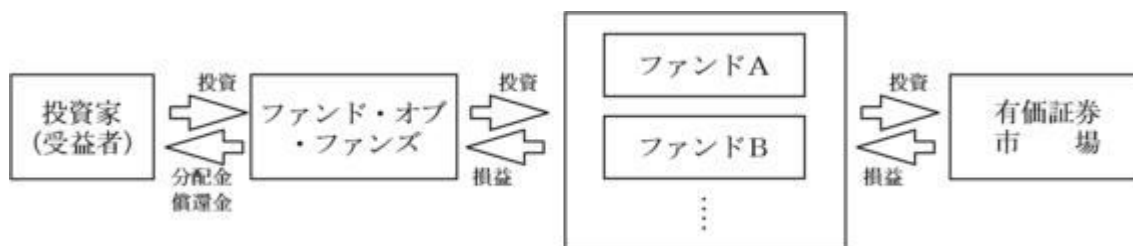
名称	住所	所有 株式数 (株)	比率 (%)

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（ファンド・オブ・ファンズによる運用）

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

〔ファンド・オブ・ファンズによる運用〕



2 【投資方針】

（1）【投資方針】

イ 基本方針

当ファンドは、安定資産ポートフォリオならびにリスク資産ポートフォリオを構成する投資信託証券への投資を通じて、下方リスクを抑制しつつ、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

（イ）主として、安定資産ポートフォリオならびにリスク資産ポートフォリオを構成する投資信託証券への投資を通じて、下方リスクを抑制しつつ、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

（ロ）運用にあたっては、安定資産ポートフォリオへの投資を基本とし、市場のリスク選好状況を定量的に捉え、リスク資産ポートフォリオの組入配分を機動的に調整します。リスク資産ポートフォリオへの投資割合の上限は40%程度とします。

（ハ）安定資産ポートフォリオ内の資産配分は均等配分を基本としますが、市況の見通しに応じて一定の範囲で調整を行う場合があります。

（ニ）リスク資産ポートフォリオ内の資産配分はモメンタム・フォロー戦略 を活用します。

モメンタム・フォロー戦略とは、「過去に良好な運用成績の資産は、一定期間良好な運用成績が継続する」という仮定を基に、過去の運用成績が良い資産の投資割合を上げる戦略です。

（ホ）実質組入外貨建資産については、ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンドを除き、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

（ヘ）投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

（ト）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 日本を含む世界のさまざまな資産に投資し、
値下がりするリスクを抑えつつ、安定的なリターンを目指します。

2 各資産の組入比率は柔軟に調整します。

■ 当ファンドでは、日本を含む世界のさまざまな資産を、安定資産とリスク資産に区別します。

安定資産・リスク資産とは？

安定資産 ……資産が目減りする可能性が低い資産のことをいいます。

リスク資産 ……安定資産と比べ値動きが大きく、より高い収益が期待できる反面、大きな損失を被る可能性のある資産のことをいいます。

■ リスク資産への投資は40%程度までとします。

■ 安定資産は、「日本国債と現預金の合計」、「為替ヘッジ付き先進国債券(除く日本)」の組入比率がほぼ半分ずつになるようにします。

※市況の見通しに応じて一定の範囲で調整を行う場合があります。

3 先進国の債券は、部分的に対円での為替ヘッジを行います。

■ 為替ヘッジを行う場合でも、完全に為替変動リスクを回避することはできません。

■ 為替ヘッジを行う場合と行わない場合で、為替の変動が当ファンドに与える影響は以下のようになると考えられます。

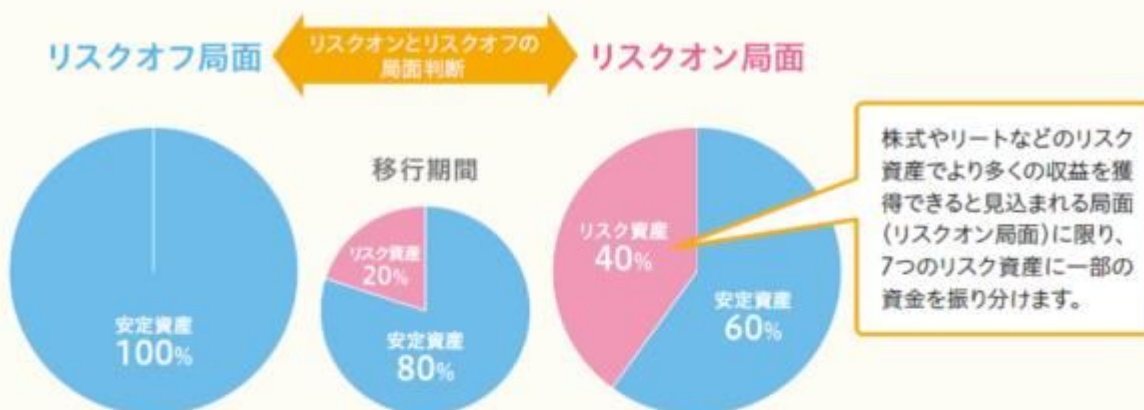
		円高となった場合	円安となった場合
日本の資産		基準価額に影響はありません。	基準価額に影響はありません。
外国の資産	為替ヘッジを行う資産	組入通貨に対し円高となった場合でも、為替差損は発生せず、基準価額へのマイナスは限定的となります。	組入通貨に対し円安となった場合でも、為替差益は発生せず、基準価額にプラスとなりません。
	為替ヘッジを行わない資産	組入通貨に対して円高となった場合、為替差損が発生し、基準価額にマイナスとなります。	組入通貨に対し円安となった場合、為替差益が発生し、基準価額にプラスとなります。

※上記は、為替ヘッジの一般的な説明であり、市況動向等によっては、上記の通りにならない場合があります。

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

▶ リスクオン・オフ局面での資産配分

■ 「リスクオン局面」、「リスクオフ局面」の判断は、「リスク態度指数」で行います。



リスクオン局面（リスク選好的な局面）

投資家がより高い収益の獲得を目指し、リスクの高い資産に積極的に資金を投入する市場環境のこと。景気や企業業績の改善、金融緩和（利下げ）、金融不安の解消（国家財政や銀行経営の改善）、地政学的リスク（戦争、テロ）の低下などが見込まれる場合、多くはリスクオン局面と判断されます。

リスクオフ局面（リスク回避的な局面）

投資家がリスクを回避するようになり、より安全な資産に資金が向かいやすい市場環境のこと。景気や企業業績の悪化、金融引締め（利上げ）、金融不安の高まり（国家財政や銀行経営の悪化）、地政学的リスク（戦争、テロ）の高まりなどが見込まれる場合、多くはリスクオフ局面と判断されます。

リスク態度指数

市場のリスク選好度合いを計るための指数です。リスクオン局面とリスクオフ局面を判断します。

（注1）リスク資産への投資は40%程度までとします。

（注2）局面判断の有効性を高めるため、資産配分の切替えを行う際に一定の移行期間を設けます。

（注3）安定資産は、「日本国債と現預金の合計」、「為替ヘッジ付き先進国債券（除く日本）」の組入比率がほぼ半分ずつになるようにします。

※上記はイメージであり、実際とは異なる場合があります。

※日本銀行によるマイナス金利政策が導入されたため、日本国債の一部がマイナス利回りとなることや、現預金に口座管理手数料が課されることがあります。このため、上図のリスクオフ局面の場合でも、日本国債および現預金の保有による損失が発生する場合があります。

（2）【投資対象】

イ 投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

- 1．有価証券
- 2．約束手形
- 3．金銭債権

（ロ）特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

- 1．為替手形

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、投資信託証券（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。））ならびに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。））または次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除き

ます。)に投資することを指図します。

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、前号の性質を有するもの
3. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）

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

八 投資対象とする金融商品

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

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

〔参考情報：投資対象とする投資信託の概要〕

以下は、2023年11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。

安定資産を構成する投資信託証券

日本国債

ファンド名	日本国債ダイナミック・アロケーション・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ●主として日本の国債に投資し、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目指します。 ●長期金利の低下（あるいは横ばい）が予想される局面では積極的に金利リスクを取得し、長期金利の上昇が予想される局面では機動的に金利リスクの圧縮を図ります。 ●長期金利の局面判定には、運用会社独自のクオンツ手法を用います。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.06%
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社

為替ヘッジ付き先進国債券（除く日本）…為替ヘッジあり

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

リスク資産を構成する投資信託証券

●すべての投資信託に投資するとは限りません。

▶ 株式

国内株式

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

先進国株式(除く日本)…為替ヘッジなし

ファンド名	外国株式インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ●主として世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指します。 ●外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社

新興国株式…為替ヘッジなし

ファンド名	エマージング株式インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ●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上場投資信託証券に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指します。 ●外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社

ファンド名	バンガード・FTSE・エマージング・マーケットETF
形態	米国籍外国投資信託(米ドル建て)
運用の基本方針	ベンチマークのパフォーマンスへの連動を目指します。
ベンチマーク	FTSEエマージング・マーケット・オールキャップ(含む中国A株)インデックス
管理費用*1	年0.08%程度
運用会社	ザ・バンガード・グループ・インク
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。

*1 管理費用とは、各ETF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の直近の目録見書等で開示されているものです(以下同じ)。

*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場合があります。直接購入される際は、先買委託手数料(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(以下同じ)。

▶リート

国内リート

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

外国リート…為替ヘッジなし

ファンド名	外国リート・インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ● S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）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。 ● 日本を除く世界各国の不動産投資信託（REIT）などを主要投資対象とします。 ● 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社

▶ 債券

先進国債券（除く日本）…為替ヘッジなし

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

新興国債券…為替ヘッジなし

ファンド名	バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF
形態	米国籍外国投資信託（米ドル建て）
運用の基本方針	ベンチマークのパフォーマンスへの連動を目指します。
ベンチマーク	ブルームバーグ米ドル建て新興市場政府債RIC基準インデックス
管理費用*1	年0.20%程度
運用会社	ザ・バンガード・グループ・インク
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。

ファンド名	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF
形態	米国籍外国投資信託（米ドル建て）
運用の基本方針	ベンチマークのパフォーマンスへの連動を目指します。
ベンチマーク	J.P.モルガンEMBIグローバル・コア・インデックス
管理費用*1	年0.39%程度
運用会社	ブラックロック・ファンド・アドバイザーズ
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。

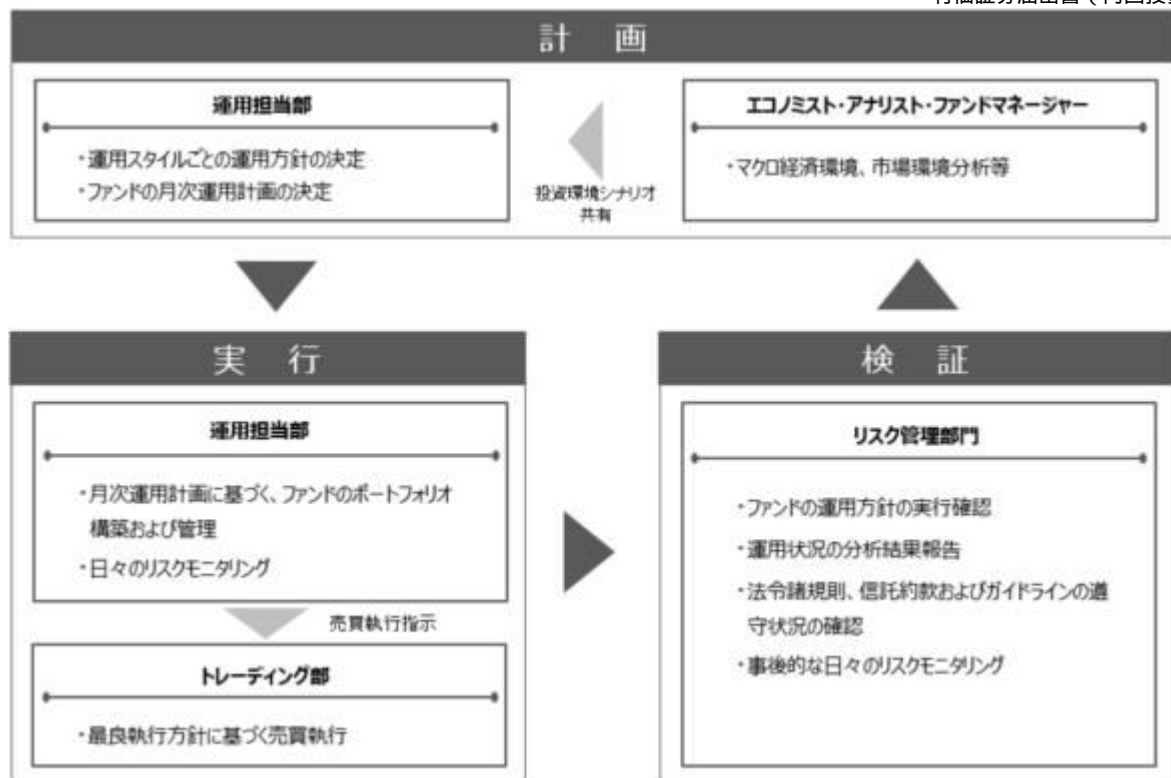

 指数の著作権など

- ・ FTSE世界国債インデックスはFTSE Fixed Income LLC、TOPIX（東証株価指数）および東証REIT指数は株式会社JPX総研、MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスはMSCI Inc.、FTSEエマージング・マーケット・オールキャップ（含む中国A株）インデックスはFTSEインターナショナル・リミテッド、S&P先進国REIT指数はS&P Dow Jones Indices LLC、ブルームバーグ米ドル建て新興市場政府債RIC基準インデックスはBloomberg、J.P.モルガンEMBIグローバル・コア・インデックスはJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが、それぞれ公表している指数です。
- ・ 各インデックスに関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は、指数を公表および許諾する各社に帰属します。また、当該各社は当ファンドの取引および運用成果等に関して一切責任を負いません。

※投資対象とする投資信託は、今後、追加・入替等を行うことがあります。

(3) 【運用体制】

イ ファンドの運用体制



リスク管理部門の人員数は、約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。

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

□ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

（４）【分配方針】

年１回（原則として毎年４月26日。ただし、休業日の場合は翌営業日）決算を行い、原則として以下の方針に基づき分配金額を決定します。

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

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

（基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。）

（５）【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく投資制限

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

ヘ 公社債の借入れの指図

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

ト 外国為替予約取引の指図

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産（投資信託証券の信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）について、当該外貨建資産の対円で為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

チ 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、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、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%を超えないこととします。
- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (ニ) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

法令に基づく投資制限

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

場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。

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

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

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

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

3【投資リスク】

イ ファンドのもつリスクの特性

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

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

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

当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

(イ) 株式市場リスク

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

(ロ) 債券市場リスク

一般に債券は内外の経済情勢等の影響による金利の変動を受けて価格が変動します。通常、金利が上昇すると債券価格は下落します。また、格付けが引き下げられる場合も債券価格が下落するおそれがあります。債券価格の下落はファンドの基準価額が下落する要因となります。なお、価格の変動幅は、債券の種類、格付け、残存期間、利払いのしくみの違い等により、債券ごとに異なります。

(ハ) 不動産投資信託(リート)に関するリスク

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

(ニ) 信用リスク

ファンドが投資している有価証券や金融商品において債務不履行が発生あるいは懸念される場合、またはその発行体が経営不安や倒産等に陥った場合には、当該有価証券や金融商品の価格が下がったり、投資資金を回収できなくなったりすることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

(ホ) 為替変動リスク

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

為替ヘッジが行われていない部分については為替変動の影響を受けます。ファンドが保有する外貨建資産の価格が現地通貨ベースで上昇する場合であっても、当該現地通貨が対円で下落する（円高となる）場合、円ベースでの評価額が下落し、基準価額が下落することがあります。為替ヘッジが行われている部分については為替変動の影響を受けますが、原則として対円で為替ヘッジを行うため、その影響は限定的と考えられます。ただし、完全に為替変動リスクを回避することはできません。対円で為替ヘッジ比率は、資産配分の調整に伴い変動します。なお、円金利がヘッジ対象通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当分のヘッジコストがかかることにご留意ください。また、需給要因等によっては金利差相当分以上にヘッジコストがかかる場合があります。

（ヘ）カントリーリスク

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

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

（ト）流動性リスク

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

□ その他の留意点

（イ）投資信託に関する留意点

- ・当ファンドは一部、実質的に「ファミリーファンド方式」により運用します。そのため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・一部解約により資金の流入が生じた場合、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性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。

（ロ）分配金に関する留意事項

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



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

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

八 投資リスクの管理体制

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

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

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

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

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

（参考情報）投資リスクの定量的比較

〔 ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移 〕

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



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

〔 ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較 〕

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



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

各資産クラスの指数

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

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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、1.76%（税抜き1.6%）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】

ファンド	純資産総額に年0.968%（税抜き0.88%）の率を乗じて得た金額が、毎日信託財産の費用として計上され、ファンドの基準価額に反映されます。また、信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。信託報酬の配分は以下の通りです。 < 信託報酬の配分（税抜き） >		
	支払先	料率	役務の内容
	委託会社	年0.45%	ファンドの運用およびそれに伴う調査、受託会社への指図、基準価額の算出、法定書面等の作成等の対価
	販売会社	年0.40%	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
	受託会社	年0.03%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価
上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。			
投資対象とする投資信託	リスク資産配分の変動幅（0%～40%）を加味した場合の管理費用の概算値は以下の通りとなります。 年0.0%～年0.156%程度* 管理費用のうち最大のもの（年0.39%程度）を用いて計算しています。なお、管理費用は、今後変更される場合があります。		
実質的な負担	ファンドの純資産総額に対して年0.968%（税抜き0.88%）～年1.124%（税抜き1.036%）程度* 実質的な負担は、実際の組入状況等により変動します。		

* 投資対象とする投資信託の運用管理費用は、2023年11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。

(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（消費税等相当額を含みます。）は、原則として、計算期間を通じて毎日、信託財産の費用として計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。
- ロ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、信託財産中から支弁します。
- ハ 有価証券の売買時の手数料、デリバティブ取引等に要する費用、および外国における資産の保管等に要する費用等（それらにかかる消費税等相当額を含みます。）は、信託財産中から支弁するものとします。

上記にかかる費用に関しましては、変更される場合があるものや、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るものがあります。したがって、あらかじめ、その金額、上限

額等を具体的に記載することはできません。

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

（５）【課税上の取扱い】

イ 個別元本について

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

ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

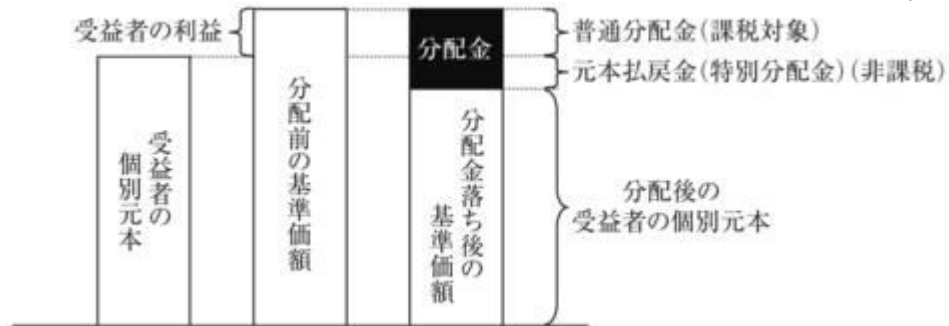
ハ 収益分配金の課税について

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

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



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



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

二 個人、法人別の課税の取扱いについて

(イ) 個人の受益者に対する課税

・収益分配時

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

・一部解約時および償還時

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

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

(ロ) 法人の受益者に対する課税

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

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

なお、当ファンドは、配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

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

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

課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等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、一定の要件を満たした場合に限りNISA（少額投資非課税制度）の適用対象となります。

当ファンドは、NISAの対象ではありません。

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2024年1月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。

(参考情報) 総経費率

直近の運用報告書の対象期間(2022年4月27日～2023年4月26日)における当ファンドの総経費率(年率換算)は以下の通りです。

投資対象とする上場投資信託(ETF)(以下、投資先ファンド)の費用は、その他費用に含めています。なお、当ファンドの費用と投資先ファンドの費用の対象期間は、異なる場合があります。

総経費率(①+②)	①運用管理費用の比率	②その他費用の比率
1.02%	0.97%	0.05%

※上記は、対象期間の運用報告書に記載されている総経費率(原則として、購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税は含まれていません。投資先ファンドは、原則として、売買委託手数料、支払利息および有価証券にかかる税金は含まれていません。)です。

※当ファンドが上記以外の上場投資信託(ETF)および上場不動産投資信託(REIT)に投資している場合、当該ETFおよびREITの管理費用等は含まれていません。

※計算方法等の詳細は、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。なお、新たな対象期間にかかる運用報告書が作成され、上記の総経費率が更新されている場合があります。

運用報告書は、委託会社のホームページ(<https://www.smd-am.co.jp/fund/unpo/>)から検索いただけます。

5【運用状況】**(1)【投資状況】****イオン・バランス戦略ファンド**

2023年11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	61,380,029	2.04
親投資信託受益証券	日本	2,924,284,779	96.99
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	29,470,795	0.97
合計(純資産総額)		3,015,135,603	100.00

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

(2)【投資資産】**【投資有価証券の主要銘柄】****イオン・バランス戦略ファンド****イ 主要投資銘柄**

2023年11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	ヘッジ付き外国 債券パッシブ・ マザーファンド	979,770,307	1.2358	1,210,778,926	1.2172	1,192,576,417	39.55
日本	親投資 信託受 益証券	日本国債ダイナ ミック・アロ ケーション・マ ザーファンド	1,043,791,047	1.1311	1,180,634,680	1.1253	1,174,578,065	38.96

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)	37,149,436	3.7780	140,349,134	4.1803	155,295,787	5.15
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	16,682,579	6.8645	114,518,229	7.4937	125,014,242	4.15
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	44,888,235	2.6806	120,326,379	2.6428	118,630,627	3.93
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	51,158,952	1.7723	90,668,860	1.8385	94,055,733	3.12
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	21,702,788	2.8065	60,909,893	2.9551	64,133,908	2.13
アメリカ	投資証 券	iシェアーズ J.P.モルガ ン・米ドル建て エマージング・ マーケット債券 ETF	4,826	12,520.80	60,425,365	12,718.61	61,380,029	2.04

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11月30日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	2.04
親投資信託受益証券	96.99
合計	99.02

【投資不動産物件】

イオン・バランス戦略ファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

イオン・バランス戦略ファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

イオン・バランス戦略ファンド

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 (2017年 4月26日)	941,887,543	941,887,543	10,191	10,191
第2期 (2018年 4月26日)	2,135,712,788	2,135,712,788	9,962	9,962
第3期 (2019年 4月26日)	2,327,681,035	2,327,681,035	10,073	10,073
第4期 (2020年 4月27日)	2,390,208,284	2,390,208,284	9,866	9,866
第5期 (2021年 4月26日)	2,730,735,805	2,730,735,805	10,191	10,191
第6期 (2022年 4月26日)	2,766,617,095	2,766,617,095	9,760	9,760
第7期 (2023年 4月26日)	2,870,220,723	2,870,220,723	9,077	9,077
2022年11月末日	2,784,734,788	-	9,223	-
12月末日	2,725,564,960	-	8,963	-
2023年 1月末日	2,801,513,126	-	9,083	-
2月末日	2,806,814,488	-	9,049	-
3月末日	2,830,293,525	-	9,063	-
4月末日	2,882,323,298	-	9,118	-
5月末日	2,930,935,882	-	9,197	-
6月末日	2,978,178,884	-	9,266	-
7月末日	2,971,157,669	-	9,217	-
8月末日	2,990,081,061	-	9,200	-
9月末日	2,951,261,666	-	9,039	-
10月末日	2,938,876,421	-	8,861	-
11月末日	3,015,135,603	-	9,111	-

【分配の推移】

イオン・バランス戦略ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2016年10月12日～2017年 4月26日	0
第2期	2017年 4月27日～2018年 4月26日	0
第3期	2018年 4月27日～2019年 4月26日	0
第4期	2019年 4月27日～2020年 4月27日	0
第5期	2020年 4月28日～2021年 4月26日	0
第6期	2021年 4月27日～2022年 4月26日	0
第7期	2022年 4月27日～2023年 4月26日	0

【収益率の推移】

イオン・バランス戦略ファンド

	収益率(%)
第1期	1.9
第2期	2.2
第3期	1.1
第4期	2.1

第5期	3.3
第6期	4.2
第7期	7.0
第8期（中間期）	2.3

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

（４）【設定及び解約の実績】

イオン・バランス戦略ファンド

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	941,628,680	17,412,426
第2期	1,491,997,945	272,427,188
第3期	510,495,142	343,373,820
第4期	564,497,467	452,619,030
第5期	586,168,237	329,442,755
第6期	664,037,761	508,829,726
第7期	558,208,711	230,853,993
第8期（中間期）	357,232,468	206,176,749

（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

日本国債ダイナミック・アロケーション・マザーファンド

2023年11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	日本	4,462,899,542	56.74
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	3,402,129,829	43.26
合計（純資産総額）		7,865,029,371	100.00

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2023年11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	10,934,892,797	46.50
	フランス	1,956,542,266	8.32
	イタリア	1,745,019,273	7.42
	中国	1,644,343,869	6.99
	ドイツ	1,501,101,687	6.38
	イギリス	1,171,125,526	4.98
	スペイン	1,149,499,650	4.89
	カナダ	454,578,793	1.93
	ベルギー	409,190,301	1.74

	オランダ	349,616,433	1.49
	オーストラリア	338,890,882	1.44
	オーストリア	275,257,536	1.17
	シンガポール	219,819,970	0.93
	メキシコ	206,686,063	0.88
	アイルランド	126,527,289	0.54
	ポーランド	115,657,546	0.49
	フィンランド	113,831,505	0.48
	デンマーク	72,847,912	0.31
	イスラエル	71,277,764	0.30
	ニュージーランド	53,200,538	0.23
	スウェーデン	47,849,162	0.20
	ノルウェー	40,853,715	0.17
	小計	22,998,610,477	97.80
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	516,573,566	2.20
合計(純資産総額)		23,515,184,043	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	-	1,153,306,066	4.90
為替予約取引	売建	-	22,601,768,104	96.12

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

2023年11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	277,901,462,330	98.32
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	4,737,495,753	1.68
合計(純資産総額)		282,638,958,083	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	4,633,200,000	1.64
合計	買建	-	4,633,200,000	1.64

外国株式インデックス・マザーファンド

2023年11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	417,983,191,996	68.82
	イギリス	23,588,383,486	3.88
	カナダ	20,110,819,511	3.31
	フランス	18,884,459,265	3.11
	スイス	18,856,499,767	3.10
	ドイツ	14,614,776,882	2.41
	オランダ	11,372,779,454	1.87

	アイルランド	10,917,180,451	1.80
	オーストラリア	10,773,219,997	1.77
	デンマーク	5,702,262,984	0.94
	スウェーデン	5,162,881,550	0.85
	スペイン	4,612,422,064	0.76
	イタリア	3,300,766,375	0.54
	香港	2,778,289,460	0.46
	ジャージー	1,938,191,190	0.32
	シンガポール	1,871,520,224	0.31
	フィンランド	1,867,603,918	0.31
	ベルギー	1,331,960,131	0.22
	ノルウェー	1,152,531,346	0.19
	イスラエル	1,152,362,629	0.19
	バミューダ	888,653,468	0.15
	ケイマン諸島	830,233,251	0.14
	オランダ領キュ ラソー	802,497,513	0.13
	ニュージーラン ド	448,317,910	0.07
	オーストリア	329,594,193	0.05
	ポルトガル	311,566,211	0.05
	ルクセンブルグ	305,041,306	0.05
	リベリア	250,729,829	0.04
	パナマ	152,937,791	0.03
	マン島	63,030,158	0.01
	小計	582,354,704,310	95.88
投資証券	アメリカ	10,292,566,897	1.69
	オーストラリア	1,089,018,842	0.18
	シンガポール	221,368,701	0.04
	フランス	217,977,481	0.04
	イギリス	207,112,310	0.03
	香港	138,806,714	0.02
	ベルギー	55,305,442	0.01
	カナダ	54,542,820	0.01
	ケイマン諸島	43,678,656	0.01
	小計	12,320,377,863	2.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	12,705,484,879	2.09
合計(純資産総額)		607,380,567,052	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	528,482,545	0.09
株価指数先物取引	買建	ドイツ	1,803,493,339	0.30
株価指数先物取引	買建	アメリカ	9,521,510,344	1.57
株価指数先物取引	買建	オーストラリア	378,076,765	0.06
合計	買建	-	12,231,562,993	2.01

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	-	1,013,288,949	0.17
為替予約取引	売建	-	341,450,952	0.06

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2023年11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	5,661,098,305	15.28
	インド	5,439,996,953	14.68
	台湾	5,325,070,389	14.37
	韓国	4,361,369,461	11.77
	中国	2,103,770,909	5.68
	ブラジル	1,868,855,817	5.04
	南アフリカ	988,899,194	2.67
	インドネシア	649,157,085	1.75
	メキシコ	643,795,031	1.74
	タイ	614,855,058	1.66
	マレーシア	473,996,770	1.28
	香港	320,041,052	0.86
	ポーランド	302,009,069	0.82
	トルコ	236,112,581	0.64
	フィリピン	215,277,086	0.58
	チリ	166,746,345	0.45
	ギリシャ	164,848,096	0.44
	バミューダ	134,557,527	0.36
	アメリカ	122,893,033	0.33
	ハンガリー	86,995,446	0.23
	チェコ	55,807,529	0.15
	イギリス	43,134,184	0.12
	エジプト	40,198,239	0.11
	ルクセンブルグ	36,329,167	0.10
	コロンビア	34,670,004	0.09
	オランダ	17,335,526	0.05
ペルー	10,570,957	0.03	
シンガポール	6,407,013	0.02	
小計		30,124,797,826	81.30
投資信託受益証券	香港	1,545,640,595	4.17
投資証券	アメリカ	2,400,045,129	6.48
	メキシコ	228,566,143	0.62
	ブラジル	81,188,037	0.22
	南アフリカ	11,433,761	0.03
	小計		2,721,233,070
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	2,664,019,526	7.19
合計（純資産総額）		37,055,691,017	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	2,665,496,680	7.19
合計	買建	-	2,665,496,680	7.19

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	-	142,820,917	0.39
為替予約取引	売建	-	336,621,269	0.91

Jリート・インデックス・マザーファンド

2023年11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	12,637,122,100	98.99
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	128,994,637	1.01
合計(純資産総額)		12,766,116,737	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	36,910,000	0.29
合計	買建	-	36,910,000	0.29

外国リート・インデックス・マザーファンド

2023年11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	23,261,144,472	76.68
	オーストラリア	2,001,791,234	6.60
	イギリス	1,478,274,214	4.87
	シンガポール	1,064,017,173	3.51
	フランス	545,055,770	1.80
	カナダ	450,501,708	1.49
	香港	363,067,900	1.20
	ベルギー	343,529,079	1.13
	スペイン	129,889,452	0.43
	ニュージーランド	88,720,107	0.29
	オランダ	58,218,398	0.19
	韓国	57,527,665	0.19
	ガーンジィ	39,641,437	0.13
	イスラエル	38,890,386	0.13
	ドイツ	12,794,993	0.04
	アイルランド	9,805,330	0.03
	イタリア	2,784,022	0.01
小計		29,945,653,340	98.72

現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	389,144,692	1.28
合計(純資産総額)		30,334,798,032	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	-	6,355,091	0.02
為替予約取引	売建	-	51,945,928	0.17

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

日本国債ダイナミック・アロケーション・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2023年11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 (%)
日本	国債 証券	3 7 2 1 0年国債	610,000,000	100.83	615,040,600	101.20	617,289,500	0.800	2033/09/20	7.85
日本	国債 証券	3 6 2 1 0年国債	450,000,000	96.82	435,694,000	97.42	438,403,500	0.100	2031/03/20	5.57
日本	国債 証券	3 6 4 1 0年国債	450,000,000	95.13	428,091,500	96.85	435,825,000	0.100	2031/09/20	5.54
日本	国債 証券	1 5 5 2 0年国債	280,000,000	98.70	276,360,000	101.53	284,278,400	1.000	2035/12/20	3.61
日本	国債 証券	3 7 1 1 0年国債	280,000,000	96.17	269,276,000	97.71	273,579,600	0.400	2033/06/20	3.48
日本	国債 証券	3 6 3 1 0年国債	280,000,000	96.04	268,904,000	97.16	272,048,000	0.100	2031/06/20	3.46
日本	国債 証券	1 8 6 2 0年国債	250,000,000	100.68	251,704,500	101.08	252,700,000	1.500	2043/09/20	3.21
日本	国債 証券	1 8 1 2 0年国債	200,000,000	90.20	180,397,600	92.43	184,864,000	0.900	2042/06/20	2.35
日本	国債 証券	1 6 1 2 0年国債	180,000,000	93.15	167,670,000	95.00	170,998,200	0.600	2037/06/20	2.17
日本	国債 証券	7 4 3 0 年国債	200,000,000	83.44	166,879,000	85.08	170,160,000	1.000	2052/03/20	2.16
日本	国債 証券	1 6 3 2 0年国債	150,000,000	94.36	141,532,500	94.26	141,387,000	0.600	2037/12/20	1.80
日本	国債 証券	1 7 3 2 0年国債	150,000,000	86.52	129,782,500	87.44	131,166,000	0.400	2040/06/20	1.67
日本	国債 証券	8 0 3 0 年国債	100,000,000	103.10	103,099,000	102.79	102,791,000	1.800	2053/09/20	1.31
日本	国債 証券	1 4 9 2 0年国債	90,000,000	108.64	97,776,900	107.70	96,930,900	1.500	2034/06/20	1.23
日本	国債 証券	5 2 3 0 年国債	120,000,000	80.41	96,490,000	80.15	96,178,800	0.500	2046/09/20	1.22
日本	国債 証券	4 8 3 0 年国債	80,000,000	101.27	81,016,000	98.12	78,492,000	1.400	2045/09/20	1.00
日本	国債 証券	6 6 3 0 年国債	100,000,000	70.72	70,724,000	73.70	73,695,000	0.400	2050/03/20	0.94
日本	国債 証券	1 6 7 2 0年国債	80,000,000	88.85	71,080,000	91.43	73,140,000	0.500	2038/12/20	0.93

日本	国債証券	17520年国債	80,000,000	85.11	68,084,000	88.10	70,476,000	0.500	2040/12/20	0.90
日本	国債証券	5730年国債	80,000,000	88.71	70,968,000	84.64	67,708,000	0.800	2047/12/20	0.86
日本	国債証券	14620年国債	60,000,000	108.79	65,274,000	109.73	65,835,600	1.700	2033/09/20	0.84
日本	国債証券	1540年国債	80,000,000	82.94	66,353,700	78.65	62,923,200	1.000	2062/03/20	0.80
日本	国債証券	17020年国債	70,000,000	88.96	62,272,000	87.29	61,103,000	0.300	2039/09/20	0.78
日本	国債証券	6030年国債	60,000,000	90.09	54,053,400	85.82	51,490,800	0.900	2048/09/20	0.65
日本	国債証券	4630年国債	50,000,000	104.32	52,158,000	100.24	50,121,000	1.500	2045/03/20	0.64
日本	国債証券	6330年国債	60,000,000	75.35	45,210,000	74.58	44,750,400	0.400	2049/06/20	0.57
日本	国債証券	1040年国債	40,000,000	85.23	34,092,000	79.60	31,841,600	0.900	2057/03/20	0.40
日本	国債証券	540年国債	18,100,000	114.51	20,725,767	107.58	19,472,342	2.000	2052/03/20	0.25
日本	国債証券	1340年国債	20,000,000	73.15	14,630,000	66.97	13,394,800	0.500	2060/03/20	0.17
日本	国債証券	16820年国債	10,000,000	90.78	9,077,500	89.60	8,960,100	0.400	2039/03/20	0.11

□ 種類別投資比率

2023年11月30日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	56.74
合計	56.74

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2023年11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	1,560,000	14,492.50	226,082,979	14,551.55	227,004,133	4.125	2025/01/31	0.97
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,520,000	14,507.40	220,512,516	14,575.96	221,554,601	4.250	2025/05/31	0.94
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,550,000	13,267.28	205,642,824	13,400.28	207,704,387	1.125	2026/10/31	0.88
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,370,000	14,490.87	198,524,952	14,628.17	200,405,935	4.125	2028/07/31	0.85
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,170,000	14,622.33	171,081,245	14,695.97	171,942,846	4.750	2025/07/31	0.73
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,290,000	11,728.01	151,291,320	11,922.67	153,802,452	1.125	2031/02/15	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,070,000	14,051.85	150,354,808	14,255.64	152,535,371	3.500	2028/04/30	0.65

中国	国債 証券	CHINA GOVERNMENT BOND	7,200,000	2,049.18	147,540,748	2,043.97	147,165,961	2.180	2026/08/15	0.63
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	950,000	14,584.78	138,555,455	14,638.32	139,064,023	4.625	2025/02/28	0.59
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	970,000	13,437.74	130,346,073	13,606.18	131,979,956	1.875	2027/02/28	0.56
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	900,000	14,296.78	128,670,982	14,476.25	130,286,224	3.875	2027/12/31	0.55
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	930,000	13,128.87	122,098,490	13,912.97	129,390,612	4.125	2053/08/15	0.55
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	920,000	13,664.27	125,711,318	13,865.91	127,566,341	0.500	2025/03/31	0.54
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	890,000	14,137.54	125,824,150	14,265.50	126,962,913	2.750	2025/05/15	0.54
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	860,000	13,856.64	119,167,114	14,163.43	121,805,491	3.625	2030/03/31	0.52
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	910,000	13,220.12	120,303,112	13,242.33	120,505,201	2.875	2032/05/15	0.51
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	800,000	14,613.94	116,911,481	14,998.79	119,990,295	4.625	2030/09/30	0.51
フランス	国債 証券	FRANCE OAT.	790,000	15,002.05	118,516,215	15,167.57	119,823,768	0.000	2026/02/25	0.51
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	950,000	12,224.61	116,133,751	12,278.29	116,643,717	1.875	2032/02/15	0.50
中国	国債 証券	CHINA GOVERNMENT BOND	5,600,000	2,062.90	115,522,593	2,049.97	114,798,118	2.180	2025/08/25	0.49
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	970,000	11,750.60	113,980,808	11,823.25	114,685,538	1.250	2031/08/15	0.49
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	870,000	12,621.38	109,805,968	12,783.77	111,218,760	1.250	2028/09/30	0.47
フランス	国債 証券	FRANCE OAT.	690,000	15,943.46	110,009,903	16,014.36	110,499,101	2.500	2026/09/24	0.47
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	750,000	14,592.10	109,440,762	14,719.50	110,396,257	4.500	2026/07/15	0.47
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	730,000	14,542.58	106,160,802	14,526.55	106,043,779	4.125	2032/11/15	0.45
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	730,000	14,224.70	103,840,323	14,330.65	104,613,729	3.625	2028/03/31	0.44
中国	国債 証券	CHINA GOVERNMENT BOND	5,000,000	2,060.89	103,044,263	2,052.38	102,618,832	2.300	2026/05/15	0.44
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	700,000	14,410.51	100,873,548	14,497.28	101,480,947	3.875	2025/04/30	0.43
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	700,000	14,128.43	98,898,986	14,258.29	99,808,026	2.625	2025/04/15	0.42
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	840,000	11,788.54	99,023,760	11,857.22	99,600,686	1.375	2031/11/15	0.42

□ 種類別投資比率

2023年11月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	97.80
合計	97.80

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11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	4,527,000	2,017.59	9,133,652,048	2,794.50	12,650,701,500	4.48
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	582,300	11,308.79	6,585,109,300	12,820.00	7,465,086,000	2.64
日本	株式	三菱UFJ フィナンシャル・グループ	銀行業	5,084,900	774.41	3,937,777,423	1,255.00	6,381,549,500	2.26
日本	株式	キーエンス	電気機器	82,400	57,360.44	4,726,500,435	63,350.00	5,220,040,000	1.85
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	24,550,000	153.36	3,764,888,524	173.10	4,249,605,000	1.50
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	577,000	4,754.97	2,743,617,001	7,258.00	4,187,866,000	1.48
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	174,300	15,233.92	2,655,272,589	24,025.00	4,187,557,500	1.48
日本	株式	日立製作所	電気機器	400,000	7,362.46	2,944,982,781	10,285.00	4,114,000,000	1.46
日本	株式	三菱商事	卸売業	574,000	4,830.99	2,772,986,626	6,886.00	3,952,564,000	1.40
日本	株式	信越化学工業	化学	743,100	3,636.97	2,702,633,982	5,212.00	3,873,037,200	1.37
日本	株式	任天堂	その他製品	519,900	5,897.74	3,066,236,198	6,912.00	3,593,548,800	1.27
日本	株式	三井物産	卸売業	654,400	4,131.38	2,703,576,688	5,392.00	3,528,524,800	1.25
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	628,000	4,343.99	2,728,026,715	5,505.00	3,457,140,000	1.22
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	584,000	4,419.06	2,580,730,952	5,738.00	3,350,992,000	1.19
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	731,800	4,073.44	2,980,939,857	4,165.00	3,047,947,000	1.08
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	2,010,000	1,132.53	2,276,391,047	1,509.00	3,033,090,000	1.07
日本	株式	KDDI	情報・通信業	637,000	4,115.14	2,621,341,137	4,625.00	2,946,125,000	1.04
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	802,400	2,842.69	2,280,973,700	3,648.00	2,927,155,200	1.04
日本	株式	第一三共	医薬品	720,400	4,495.84	3,238,805,809	4,000.00	2,881,600,000	1.02
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,105,300	1,752.79	1,937,353,995	2,512.00	2,776,513,600	0.98
日本	株式	HOYA	精密機器	164,000	14,125.20	2,316,533,503	16,665.00	2,733,060,000	0.97
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	406,000	5,984.40	2,429,665,575	6,020.00	2,444,120,000	0.86
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,326,000	1,501.66	1,991,206,316	1,798.50	2,384,811,000	0.84

日本	株式	オリエンタル ランド	サービス 業	449,000	4,016.90	1,803,587,075	5,025.00	2,256,225,000	0.80
日本	株式	ダイキン工業	機械	99,200	22,608.03	2,242,716,944	22,155.00	2,197,776,000	0.78
日本	株式	村田製作所	電気機器	749,700	2,491.25	1,867,691,639	2,883.50	2,161,759,950	0.76
日本	株式	S M C	機械	25,200	62,196.83	1,567,360,117	74,450.00	1,876,140,000	0.66
日本	株式	日本たばこ産 業	食料品	493,400	2,819.77	1,391,276,900	3,801.00	1,875,413,400	0.66
日本	株式	三菱電機	電気機器	916,000	1,424.24	1,304,604,911	2,009.00	1,840,244,000	0.65
日本	株式	丸紅	卸売業	721,900	1,624.96	1,173,055,687	2,307.00	1,665,423,300	0.59

□ 種類別・業種別投資比率

2023年11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	0.37
	建設業	2.04
	食料品	3.37
	繊維製品	0.41
	パルプ・紙	0.17
	化学	5.88
	医薬品	4.66
	石油・石炭製品	0.47
	ゴム製品	0.71
	ガラス・土石製品	0.67
	鉄鋼	0.96
	非鉄金属	0.67
	金属製品	0.52
	機械	5.13
	電気機器	17.02
	輸送用機器	8.53
	精密機器	2.29
	その他製品	2.26
	電気・ガス業	1.35
	陸運業	2.73
	海運業	0.74
	空運業	0.44
	倉庫・運輸関連業	0.15
	情報・通信業	7.55
	卸売業	6.90
	小売業	4.21
	銀行業	7.06
	証券、商品先物取引業	0.78
	保険業	2.40
その他金融業	1.13	
不動産業	1.92	
サービス業	4.73	
合計		98.32

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11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	1,178,730	21,290.97	25,096,301,188	27,850.65	32,828,391,841	5.40
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア・ サービ ス	529,731	36,592.44	19,384,147,568	55,717.47	29,515,270,835	4.86
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消 費財・ サービ ス流 通・小 売り	692,035	14,140.41	9,785,660,500	21,519.28	14,892,096,595	2.45
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導 体・半 導体製 造装置	185,105	26,564.97	4,917,308,766	70,799.50	13,105,341,077	2.16
アメリカ	株式	ALPHABET INC- CL A	メディ ア・娛 楽	445,227	14,407.39	6,414,560,231	19,852.98	8,839,082,414	1.46
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディ ア・娛 楽	165,862	18,364.72	3,046,009,705	48,856.65	8,103,462,345	1.33
アメリカ	株式	ALPHABET INC- CL C	メディ ア・娛 楽	396,590	14,363.76	5,696,524,408	20,060.35	7,955,733,413	1.31
アメリカ	株式	TESLA INC	自動 車・自 動車部 品	214,241	27,695.50	5,933,510,869	35,905.67	7,692,466,603	1.27
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルス ケア機 器・ サービ ス	70,017	76,977.26	5,389,716,674	78,679.51	5,508,903,153	0.91

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	60,686	54,350.53	3,298,316,389	87,044.85	5,282,403,779	0.87
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	97,122	46,617.17	4,527,552,828	52,752.54	5,123,432,024	0.84
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	219,809	20,232.26	4,447,233,619	22,695.84	4,988,750,422	0.82
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	33,229	84,752.08	2,816,226,908	138,367.87	4,597,825,889	0.76
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	121,762	31,187.96	3,797,508,807	37,389.61	4,552,633,217	0.75
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	300,185	16,212.29	4,866,686,438	15,051.14	4,518,127,601	0.74
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	180,442	25,661.67	4,630,443,542	22,370.82	4,036,635,087	0.66
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	177,416	21,463.38	3,807,946,417	22,226.69	3,943,370,273	0.65
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	63,063	51,115.18	3,223,476,886	60,272.23	3,800,947,476	0.63
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	245,570	9,713.23	2,385,278,142	14,932.40	3,666,950,450	0.60
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	75,103	46,551.04	3,496,122,410	45,741.71	3,435,339,751	0.57

スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	200,093	18,710.70	3,743,879,156	16,709.35	3,343,424,529	0.55
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	34,076	49,689.00	1,693,202,338	90,799.55	3,094,085,373	0.51
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	30,212	91,811.92	2,773,821,842	101,622.09	3,070,206,643	0.51
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	33,432	77,794.77	2,600,834,885	86,456.57	2,890,416,054	0.48
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	136,457	26,295.54	3,588,209,942	21,164.84	2,888,091,076	0.48
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	191,252	15,977.16	3,055,664,726	14,873.19	2,844,527,161	0.47
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	133,033	23,046.35	3,065,925,469	20,369.20	2,709,775,118	0.45
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	309,873	9,156.57	2,837,373,932	8,563.89	2,653,717,077	0.44
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	111,744	22,483.48	2,512,394,174	22,954.69	2,565,048,387	0.42
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	103,827	26,836.44	2,786,347,411	24,584.22	2,552,505,934	0.42

□ 種類別・業種別投資比率

2023年11月30日現在

種類	業種	投資比率 (%)
株式（外国）	エネルギー	4.82
	素材	3.93
	資本財	6.53
	商業・専門サービス	1.55

運輸	1.70	
自動車・自動車部品	2.05	
耐久消費財・アパレル	1.53	
消費者サービス	2.05	
一般消費財・サービス流通・小売り	4.51	
生活必需品流通・小売り	1.65	
食品・飲料・タバコ	3.56	
家庭用品・パーソナル用品	1.66	
ヘルスケア機器・サービス	4.30	
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.81	
銀行	5.21	
金融サービス	6.52	
保険	3.12	
ソフトウェア・サービス	10.22	
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.82	
半導体・半導体製造装置	6.24	
電気通信サービス	1.19	
公益事業	2.68	
メディア・娯楽	5.92	
不動産管理・開発	0.33	
投資証券	-	2.03
合計		97.91

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11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	857,000	2,334.03	2,000,266,833	2,704.46	2,317,720,848	6.25
香港	投資信 託受益 証券	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	-	2,095,800	818.5052	1,715,423,215	737.4943	1,545,640,595	4.17
ケイマ ン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディ ア・娯楽	233,200	5,398.69	1,258,975,399	5,972.28	1,392,735,696	3.76
アメリ カ	投資証 券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	-	240,096	5,754.58	1,381,651,688	5,798.97	1,392,309,525	3.76
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	166,216	7,012.29	1,165,554,701	8,295.07	1,378,773,355	3.72

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	571,500	1,513.98	865,239,762	1,369.67	782,765,262	2.11
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	105,896	4,331.79	458,719,058	4,273.25	452,519,658	1.22
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI UAE ETF	-	204,010	2,249.78	458,977,111	2,173.69	443,455,435	1.20
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	20,779	12,316.48	255,924,060	20,844.23	433,122,278	1.17
ケイマン諸島	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	177,060	2,831.95	501,424,603	1,704.08	301,724,050	0.81
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	116,069	2,852.23	331,055,516	2,598.09	301,557,476	0.81
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI QATAR ETF	-	118,705	2,923.86	347,077,087	2,539.90	301,498,698	0.81
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	179,956	1,669.98	300,523,780	1,672.49	300,974,250	0.81
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	19,106	10,042.59	191,873,730	14,878.64	284,271,295	0.77
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	3,364,000	88.47	297,620,458	84.40	283,932,364	0.77
インド	株式	HDFC BANK LIMITED	銀行	96,928	2,820.23	273,359,358	2,775.29	269,003,018	0.73
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI KUWAIT ETF	-	59,959	5,106.42	306,175,936	4,382.69	262,781,469	0.71
ブラジル	株式	VALE SA	素材	119,188	2,494.31	297,291,269	2,200.58	262,282,334	0.71
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	53,000	3,324.27	176,186,074	4,466.60	236,729,630	0.64
ケイマン諸島	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	67,800	2,159.29	146,399,663	3,330.91	225,835,833	0.61
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	436,800	474.80	207,390,911	480.58	209,918,741	0.57
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	31,793	6,045.06	192,190,740	6,254.48	198,848,523	0.54
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	28,599	6,269.29	179,295,382	6,594.98	188,609,833	0.51

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	6,820	20,657.45	140,883,800	26,922.60	183,612,101	0.50
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	167,300	782.64	130,936,204	1,055.50	176,584,789	0.48
ケイマン諸島	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・娯楽	79,050	2,006.20	158,590,254	2,168.48	171,418,660	0.46
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	1,947,400	86.49	168,435,543	85.44	166,385,856	0.45
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	82,285	3,654.56	300,715,444	2,008.34	165,256,586	0.45
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	2,288,000	72.18	165,158,544	70.08	160,354,022	0.43
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	235,000	903.65	212,356,795	673.53	158,279,550	0.43

□ 種類別・業種別投資比率

2023年11月30日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式（外国）	エネルギー	4.22
	素材	5.80
	資本財	3.60
	商業・専門サービス	0.04
	運輸	1.61
	自動車・自動車部品	3.34
	耐久消費財・アパレル	1.14
	消費者サービス	2.14
	一般消費財・サービス流通・小売り	5.18
	生活必需品流通・小売り	1.40
	食品・飲料・タバコ	2.36
	家庭用品・パーソナル用品	0.75
	ヘルスケア機器・サービス	0.72
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.32
	銀行	11.74
	金融サービス	2.22
	保険	2.27
	ソフトウェア・サービス	2.16
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.27
	半導体・半導体製造装置	8.91
電気通信サービス	1.87	
公益事業	2.04	

	メディア・娯楽	6.17
	不動産管理・開発	1.01
投資信託受益証券	-	4.17
投資証券	-	7.34
合計		92.81

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11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	1,403	594,714.12	834,383,905	621,000.00	871,263,000	6.82
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,234	587,975.36	725,561,594	575,000.00	709,550,000	5.56
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	3,884	171,395.18	665,698,894	169,800.00	659,503,200	5.17
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	2,093	287,328.90	601,379,389	280,400.00	586,877,200	4.60
日本	投資証券	KDX不動産投資法人	3,458	169,497.73	586,123,153	169,500.00	586,131,000	4.59
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	5,759	98,787.42	568,916,744	98,500.00	567,261,500	4.44
日本	投資証券	GLP投資法人	4,059	139,431.80	565,953,657	139,700.00	567,042,300	4.44
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	1,812	280,627.62	508,497,256	263,800.00	478,005,600	3.74
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	2,394	181,922.75	435,523,055	174,400.00	417,513,600	3.27
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	2,689	155,452.80	418,012,581	145,000.00	389,905,000	3.05
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	1,179	353,202.34	416,425,557	325,000.00	383,175,000	3.00
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	5,821	58,938.46	343,080,781	60,000.00	349,260,000	2.74
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	3,614	83,548.37	301,943,809	84,700.00	306,105,800	2.40
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	822	363,111.44	298,477,602	371,000.00	304,962,000	2.39
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	4,024	74,554.63	300,007,818	69,400.00	279,265,600	2.19
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	630	404,578.70	254,884,582	406,500.00	256,095,000	2.01

日本	投資証券	産業ファンド投資法人	1,836	143,143.37	262,811,234	138,000.00	253,368,000	1.98
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	415	666,536.99	276,612,851	608,000.00	252,320,000	1.98
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	1,539	150,063.62	230,947,917	157,600.00	242,546,400	1.90
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	499	486,203.48	242,615,538	467,000.00	233,033,000	1.83
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	769	301,079.64	231,530,240	288,500.00	221,856,500	1.74
日本	投資証券	イオンリート投資法人	1,472	146,684.90	215,920,173	143,800.00	211,673,600	1.66
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	445	469,568.30	208,957,894	453,500.00	201,807,500	1.58
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	1,416	144,968.34	205,275,171	140,600.00	199,089,600	1.56
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	1,781	110,734.56	197,218,246	109,300.00	194,663,300	1.52
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	592	338,303.80	200,275,851	318,000.00	188,256,000	1.47
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	1,126	164,749.12	185,507,504	155,100.00	174,642,600	1.37
日本	投資証券	森トラストリート投資法人	2,322	74,047.51	171,938,322	73,700.00	171,131,400	1.34
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	251	670,717.15	168,350,005	677,000.00	169,927,000	1.33
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	414	396,677.64	164,224,541	383,000.00	158,562,000	1.24

ロ 種類別投資比率

2023年11月30日現在

種類	投資比率（％）
投資証券	98.99
合計	98.99

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11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	150,979	17,832.07	2,692,268,499	16,624.79	2,509,994,592	8.27
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	15,309	112,534.65	1,722,792,982	118,878.15	1,819,905,624	6.00
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	90,088	11,935.66	1,075,260,176	12,971.57	1,168,583,158	3.85

アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	49,765	18,762.73	933,727,219	20,325.07	1,011,477,307	3.33
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	26,016	40,127.61	1,043,959,861	37,929.35	986,770,047	3.25
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	53,803	16,318.28	877,972,376	18,054.31	971,376,213	3.20
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	116,604	8,242.87	961,151,643	7,893.25	920,384,161	3.03
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	166,963	4,457.94	744,311,508	4,356.21	727,326,457	2.40
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	34,895	18,643.19	650,553,958	19,049.98	664,748,950	2.19
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	280,151	2,187.11	612,722,253	2,272.53	636,652,672	2.10
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	23,438	26,517.81	621,524,314	25,123.97	588,855,564	1.94
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	57,073	9,377.99	535,230,071	8,321.22	474,917,023	1.57
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	95,236	4,931.01	469,609,958	4,847.43	461,649,576	1.52
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	47,715	8,902.04	424,760,941	9,306.59	444,063,922	1.46
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	65,757	6,376.53	419,301,690	6,678.45	439,154,751	1.45
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	25,833	16,979.26	438,625,103	16,032.10	414,157,257	1.37
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	20,036	18,351.25	367,685,640	18,824.96	377,176,898	1.24
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	19,384	20,863.81	404,424,016	18,216.09	353,100,692	1.16
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,670	34,725.29	370,518,892	31,212.67	333,039,147	1.10
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	35,014	9,304.19	325,777,032	9,146.28	320,247,963	1.06
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	30,117	9,911.08	298,491,914	10,308.14	310,450,140	1.02
香港	投資証券	LINK REIT	419,100	730.40	306,109,579	732.88	307,148,331	1.01
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	200,140	1,355.18	271,225,992	1,532.84	306,781,668	1.01
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	117,928	2,308.92	272,286,333	2,564.90	302,473,621	1.00
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	103,398	2,752.15	284,566,432	2,797.27	289,232,268	0.95
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	42,352	6,753.06	286,005,575	6,747.57	285,773,152	0.94
アメリカ	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	51,482	5,208.97	268,168,370	5,263.64	270,982,472	0.89

アメリカ	投資証券	REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	33,737	7,663.51	258,543,769	7,160.84	241,585,201	0.80
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	26,538	9,027.16	239,562,681	9,040.39	239,913,946	0.79
アメリカ	投資証券	UDR INC	48,632	5,694.55	276,937,375	4,895.96	238,100,341	0.78

□ 種類別投資比率

2023年11月30日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	98.72
合計	98.72

投資不動産物件

日本国債ダイナミック・アロケーション・マザーファンド
該当事項はありません。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド
該当事項はありません。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)
該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド
該当事項はありません。

エマージング株式インデックス・マザーファンド
該当事項はありません。

Jリート・インデックス・マザーファンド
該当事項はありません。

外国リート・インデックス・マザーファンド
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

日本国債ダイナミック・アロケーション・マザーファンド
該当事項はありません。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2023年11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	4,083,348.65	606,428,160	600,392,349	2.55
	ユーロ	買建	2,505,505.50	406,072,686	404,598,830	1.72
	イギリス・ポンド	買建	327,809.62	61,225,692	61,235,138	0.26
	カナダ・ドル	買建	216,525.19	23,599,810	23,426,213	0.10

オーストラリア・ドル	買建	237,259.40	23,181,116	23,115,199	0.10
シンガポール・ドル	買建	106,036.03	11,770,912	11,702,941	0.05
メキシコ・ペソ	買建	1,094,101.14	9,453,691	9,307,846	0.04
オフショア・人民元	買建	400,000.00	8,187,736	8,236,040	0.04
ニュージーランド・ドル	買建	34,065.43	3,050,447	3,088,687	0.01
デンマーク・クローネ	買建	141,658.97	3,084,867	3,067,993	0.01
ノルウェー・クローネ	買建	200,273.32	2,792,253	2,765,353	0.01
スウェーデン・クローナ	買建	166,767.20	2,371,153	2,369,477	0.01
アメリカ・ドル	売建	72,870,000.00	10,969,869,195	10,708,319,370	45.54
ユーロ	売建	46,370,000.00	7,402,250,195	7,484,739,358	31.83
オフショア・人民元	売建	81,120,000.00	1,668,896,578	1,670,268,912	7.10
イギリス・ポンド	売建	6,130,000.00	1,122,424,457	1,144,451,997	4.87
カナダ・ドル	売建	4,090,000.00	444,177,991	442,261,516	1.88
オーストラリア・ドル	売建	3,430,000.00	328,094,538	334,028,835	1.42
シンガポール・ドル	売建	1,960,000.00	215,922,354	216,223,084	0.92
メキシコ・ペソ	売建	24,070,000.00	200,340,423	204,452,987	0.87
ポーランド・ズロチ	売建	3,130,000.00	112,065,481	116,249,452	0.49
デンマーク・クローネ	売建	3,320,000.00	71,002,445	71,871,028	0.31
イスラエル・シェケル	売建	1,750,000.00	65,755,463	69,795,075	0.30
ニュージーランド・ドル	売建	570,000.00	50,003,819	51,658,701	0.22
スウェーデン・クローナ	売建	3,330,000.00	45,145,453	47,290,662	0.20
ノルウェー・クローネ	売建	2,910,000.00	39,362,310	40,157,127	0.17

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

2023年11月30日現在

種類	国/地域	取引所等	名称	買建/売建	数量	通貨	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	日本	大阪取引所	TOPIX先物0512月2023年12月	買建	195	日本・円	4,501,574,500	4,633,200,000	1.64

(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11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	I C E - E U	F T S E 1 0 O I D X F U T D E C 2 3 2023年12 月	買建	38	イギリ ス・ポ ンド	2,848,821.00	532,273,715	2,828,530.00	528,482,545	0.09
	ドイ ツ	E U R E X	E U R O S T O X X 5 0 D E C 2 3 2023年12 月	買建	255	ユーロ	10,654,080.00	1,720,740,460	11,166,450.00	1,803,493,339	0.30
	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 D E C 2 3 2023年12 月	買建	284	アメリ カ・ド ル	61,801,702.00	9,089,176,313	64,741,350.00	9,521,510,344	1.57
	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 D E C 2 3 2023年 12月	買建	22	オー スト ラリ ア・ド ル	3,842,449.00	374,446,655	3,879,700.00	378,076,765	0.06

(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11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	5,997,000.00	880,492,733	881,407,875	0.15
	ユーロ	買建	514,000.00	82,964,842	82,966,487	0.01
	イギリス・ポンド	買建	262,000.00	48,914,666	48,914,587	0.01
	アメリカ・ドル	売建	1,974,000.00	292,266,242	290,264,629	0.05
	イギリス・ポンド	売建	274,000.00	51,266,961	51,186,323	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11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 D E C 2 3 2023年12 月	買建	368	アメリ カ・ド ル	17,958,973.00	2,641,226,159	18,124,000.00	2,665,496,680	7.19
----------------------	----------	-------------------	---	----	-----	-----------------	---------------	---------------	---------------	---------------	------

(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11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	971,765.33	142,700,000	142,820,917	0.39
	アメリカ・ドル	売建	2,289,221.14	339,000,000	336,621,269	0.91

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

Jリート・インデックス・マザーファンド

2023年11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 1 2 月 2 0 2 3 年 1 2 月	買建	20	日本・円	37,778,400	36,910,000	0.29

(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11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	43,218.33	6,400,000	6,355,091	0.02
	アメリカ・ドル	売建	353,442.41	51,900,000	51,945,928	0.17

(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11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



※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
2023年4月	0円
2022年4月	0円
2021年4月	0円
2020年4月	0円
2019年4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。
※直近5計算期間を記載しています。

主要な資産の状況

■イオン・バランス戦略ファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	96.99
投資証券	アメリカ	2.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.97
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	39.55
日本	親投資信託受益証券	日本国債ダイナミック・アロケーション・マザーファンド	38.96
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)	5.15
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	4.15
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	3.93
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	3.12
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	2.13
アメリカ	投資証券	iシェアーズ J.P.モルガン・米ドル建てエマージング・マーケット債券ETF	2.04

※比率は、ファンドの純資産総額に対する時価の比率です。

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

▶投資対象とする投資信託の現況

■日本国債ダイナミック・アロケーション・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	国債証券	372 10年国債	0.800	2033/09/20	7.85
日本	国債証券	362 10年国債	0.100	2031/03/20	5.57
日本	国債証券	364 10年国債	0.100	2031/09/20	5.54
日本	国債証券	155 20年国債	1.000	2035/12/20	3.61
日本	国債証券	371 10年国債	0.400	2033/06/20	3.48
日本	国債証券	363 10年国債	0.100	2031/06/20	3.46
日本	国債証券	186 20年国債	1.500	2043/09/20	3.21
日本	国債証券	181 20年国債	0.900	2042/06/20	2.35
日本	国債証券	161 20年国債	0.600	2037/06/20	2.17
日本	国債証券	74 30年国債	1.000	2052/03/20	2.16

■ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.125	2025/01/31	0.97
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2025/05/31	0.94
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.125	2026/10/31	0.88
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.125	2028/07/31	0.85
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.750	2025/07/31	0.73
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.125	2031/02/15	0.65
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.500	2028/04/30	0.65
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.180	2026/08/15	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.625	2025/02/28	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.875	2027/02/28	0.56

■国内株式インデックス・マザーファンド (B号)

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	4.48
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2.64
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.26
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.85
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.50
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.48
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	1.48
日本	株式	日立製作所	電気機器	1.46
日本	株式	三菱商事	卸売業	1.40
日本	株式	信越化学工業	化学	1.37

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

■外国株式インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.40
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4.86
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	2.45
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	2.16
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	1.46
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	1.33
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1.31
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	1.27
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	0.91
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	0.87

■エマージング株式インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	6.25
香港	投資信託 受益証券	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	—	4.17
ケイマン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	3.76
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	—	3.76
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.72
ケイマン諸島	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費財・サービス流通・小売り	2.11
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	1.22
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI UAE ETF	—	1.20
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	1.17
ケイマン諸島	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	0.81

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

■ Jリート・インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位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	6.82
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	5.56
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	5.17
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	4.60
日本	投資証券	KDX不動産投資法人	4.59
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	4.44
日本	投資証券	GLP投資法人	4.44
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	3.74
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	3.27
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	3.05

■ 外国リート・インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	8.27
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	6.00
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	3.85
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	3.33
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	3.25
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	3.20
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	3.03
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	2.40
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	2.19
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	2.10

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



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

※ファンドが設定された年の収益率は、設定日から年末までの騰落率です。

※2023年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。

※ファンドにはベンチマークはありません。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

イ 申込方法

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

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

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

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

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

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

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

(ニ) 申込不可日

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

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

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

ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

ハ 申込手数料

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、1.76%（税抜き1.6%）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。

二 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社にお問い合わせください。

ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

取得申込者は、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）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、委託会社の指定する口座を経由して、追加設定が行われる日に、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

ただし、以下のいずれかに当たる場合には、解約請求の受け付けは行いません。

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

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

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

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して6営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

イ 基準価額の算出方法

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

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

< マザーファンドの主要投資対象の評価方法 >

主要投資対象	有価証券等の評価方法
--------	------------

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

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

□ 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、「みらいパレ」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	コールセンター	ホームページ
三井住友DSアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	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】

2016年10月12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4月27日から翌年4月26日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5) 【その他】

イ 信託の終了

(イ) 信託契約の解約

- a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、残存口数が10億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ま

- す。
- b. 委託会社は、上記aの事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知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発送します。
 - 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、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
 - d. 書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
 - e. 上記b～dまでの取扱いは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b～dまでの取扱いを行うことが困難な場合も同様とします。
- (ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令
- 委託会社は、監督官庁より当ファンドの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い信託契約を解約し、信託を終了させます。
- (ハ) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い
- 委託会社が、監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が当ファンドに関する委託会社の業務を他の委託会社に引継ぐことを命じたときは、当ファンドは、その委託会社と受託会社との間において存続します。
- (二) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い
- a. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。
 - b. 上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。
 - c. 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- ロ 収益分配金、償還金の支払い
- (イ) 収益分配金
- a. 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
 - b. 分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払われます。
- ただし、分配金自動再投資コースにかかる収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づいて、毎計算期間終了日の翌営業日に無手数料で再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。
- (ロ) 償還金
- 償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記

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

八 信託約款の変更等

- (イ) 委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。
- (ロ) 委託会社は、上記(イ)の事項(変更についてはその内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知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。
- (ハ) 上記(ロ)の書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、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使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います(書面決議は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。)
- (ホ) 上記(ロ)から(ニ)までの取扱いは、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- (ヘ) 上記にかかわらず、当ファンドと他のファンドとの併合の場合は、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあつても、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応じて請求する権利を有します。

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

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

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

ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

ハ 一部解約実行請求権

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

ニ 書面決議における議決権

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

ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期(2022年4月27日から2023年4月26日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【イオン・バランス戦略ファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第6期 (2022年 4月26日現在)	第7期 (2023年 4月26日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	1,248,007	3,302,157
金銭信託	816,181	1,039,513
コール・ローン	41,167,565	46,638,683
投資証券	-	174,635,654
親投資信託受益証券	2,739,370,506	2,659,817,137
未収入金	2,000,000	-
流動資産合計	2,784,602,259	2,885,433,144
資産合計		
	2,784,602,259	2,885,433,144
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,496,292	1,647,431
未払受託者報酬	456,682	459,260
未払委託者報酬	12,940,825	13,013,847
その他未払費用	91,365	91,883
流動負債合計	17,985,164	15,212,421
負債合計		
	17,985,164	15,212,421
純資産の部		
元本等		
元本	2,834,720,287	3,162,075,005
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	68,103,192	291,854,282
(分配準備積立金)	68,473,772	79,242,530
元本等合計	2,766,617,095	2,870,220,723
純資産合計		
	2,766,617,095	2,870,220,723
負債純資産合計		
	2,784,602,259	2,885,433,144

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第6期		第7期	
	自 至	2021年 4月27日 2022年 4月26日	自 至	2022年 4月27日 2023年 4月26日
営業収益				
受取配当金		1,290,403		1,978,072
受取利息		365		11,389
有価証券売買等損益		96,892,611		175,563,048
為替差損益		2,660,833		901,713
営業収益合計		92,941,010		174,475,300
営業費用				
支払利息		26,403		15,092
受託者報酬		911,884		918,764
委託者報酬		25,838,373		26,034,482
その他費用		230,421		200,821
営業費用合計		27,007,081		27,169,159
営業利益又は営業損失（ ）		119,948,091		201,644,459
経常利益又は経常損失（ ）		119,948,091		201,644,459
当期純利益又は当期純損失（ ）		119,948,091		201,644,459
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（ ）		5,279,553		9,372,064
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		51,223,553		68,103,192
剰余金増加額又は欠損金減少額		16,267,363		6,104,847
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		6,104,847
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		16,267,363		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		10,366,464		37,583,542
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		10,366,464		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		37,583,542
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		68,103,192		291,854,282

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第7期	
	自 2022年4月27日 至 2023年4月26日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>	
3. 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>	

(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6期	第7期
	(2022年4月26日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,834,720,287口	3,162,075,005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 68,103,192円	元本の欠損 291,854,282円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9760円 (1万口当たりの純資産額9,760円)	1口当たり純資産額 0.9077円 (1万口当たりの純資産額9,077円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第6期	第7期
	自 2021年4月27日 至 2022年4月26日	
	自 2022年4月27日 至 2023年4月26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(9,900,466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(65,454,207円)、および分配準備積立金(58,573,306円)より、分配対象収益は133,927,979円(1万口当たり472.46円)ですが、分配を行っていません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(15,870,112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(86,518,983円)、および分配準備積立金(63,372,418円)より、分配対象収益は165,761,513円(1万口当たり524.22円)ですが、分配を行っていません。</p>
----------	---	--

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	<p style="text-align: center;">第7期 自 2022年4月27日 至 2023年4月26日</p>
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第7期 (2023年4月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第6期（自 2021年4月27日 至 2022年4月26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	115,537,237円
合計	115,537,237円

第7期（自 2022年4月27日 至 2023年4月26日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	1,505,057円
親投資信託受益証券	71,748,787円
合計	73,253,844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7期 自 2022年4月27日 至 2023年4月26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6期 (2022年4月26日現在)	第7期 (2023年4月26日現在)
期首元本額	2,679,512,252円	2,834,720,287円
期中追加設定元本額	664,037,761円	558,208,711円
期中一部解約元本額	508,829,726円	230,853,993円

（4）【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	i シェアーズ J . P . モル ガン・米ドル建てエマー ジグ・マーケット債券 E T F	15,253.00	1,305,199.21	
		アメリカ・ドル小計	15,253.00	1,305,199.21 (174,635,654)	
投資証券合計				174,635,654 (174,635,654)	
親投資信託受 益証券	日本・円	国内株式インデックス・マ ザーファンド（B号）	48,802,794	171,849,278	
		外国株式インデックス・マ ザーファンド	27,693,062	172,511,160	

	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	668,406,963	845,601,648	
	Jリート・インデックス・マザーファンド	44,262,348	114,502,268	
	外国リート・インデックス・マザーファンド	106,804,485	285,317,501	
	エマージング株式インデックス・マザーファンド	138,659,796	223,519,591	
	日本国債ダイナミック・アロケーション・マザーファンド	740,997,629	846,515,691	
	日本・円小計	1,775,627,077	2,659,817,137	
親投資信託受益証券合計			2,659,817,137	(-)
合 計			2,834,452,791	(174,635,654)

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

通貨	銘柄数	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 1銘柄	6.1%	100.0%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

イオン・バランス戦略ファンドは、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「ヘッジ付き外国債券パッシブ・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」、「エマージング株式インデックス・マザーファンド」および「日本国債ダイナミック・アロケーション・マザーファンド」受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2022年4月26日現在)	(2023年4月26日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	38,460,616	77,873,996
コール・ローン	1,939,925,432	3,493,885,269
株式	196,699,150,170	228,784,745,920
派生商品評価勘定	10,660,800	123,674,400
未収入金	-	2,162,700
未収配当金	2,368,445,415	2,721,055,618
前払金	120,890,000	-

差入委託証拠金	183,300,000	252,720,000
流動資産合計	201,360,832,433	235,456,117,903
資産合計	201,360,832,433	235,456,117,903
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	123,711,500	-
前受金	-	183,867,000
未払解約金	95,194,113	184,681,894
その他未払費用	4,482	7,279
流動負債合計	218,910,095	368,556,173
負債合計	218,910,095	368,556,173
純資産の部		
元本等		
元本	63,261,805,196	66,762,415,456
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	137,880,117,142	168,325,146,274
元本等合計	201,141,922,338	235,087,561,730
純資産合計	201,141,922,338	235,087,561,730
負債純資産合計	201,360,832,433	235,456,117,903

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年4月27日 至 2023年4月26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>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

（貸借対照表に関する注記）

項 目	（2022年4月26日現在）	（2023年4月26日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	63,261,805,196口	66,762,415,456口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.1795円 （1万口当たりの純資産額31,795円）	1口当たり純資産額 3.5213円 （1万口当たりの純資産額35,213円）

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項 目	自 2022年4月27日 至 2023年4月26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、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、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、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>
--------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年4月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（株式） 「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4月26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 0406月	4,559,170,700	-	4,446,120,000	113,050,700
	小計	4,559,170,700	-	4,446,120,000	113,050,700
合 計		4,559,170,700	-	4,446,120,000	113,050,700

(2023年4月26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	6,130,485,600	-	6,254,160,000	123,674,400
	小計	6,130,485,600	-	6,254,160,000	123,674,400
合 計		6,130,485,600	-	6,254,160,000	123,674,400

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2022年4月27日 至 2023年4月26日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2022年4月26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	60,391,040,010円
同期中における追加設定元本額	11,694,994,809円
同期中における一部解約元本額	8,824,229,623円
2022年4月26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	9,498,830,729円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	981,562,776円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,546,847,970円

三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,448,440,778円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	129,139,788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)	4,784,541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)	20,168,646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)	63,518,648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)	153,838,056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)	133,882,770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)	245,294,698円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,502,049,659円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	19,696,465,018円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	146,334,176円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	231,330,362円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	152,943,467円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	32,080,235円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	182,885,633円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	166,474,648円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	591,913,486円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	322,705,825円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	368,867,306円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	41,699,673円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	551,666,449円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	17,990,681円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	90,470,993円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	95,218,221円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	4,109,911円
日興FWS・日本株インデックス	592,212,994円
三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド	5,338,179円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,749,396,476円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	18,579,823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>	97,797,524円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	1,766,376,348円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	1,639,438,827円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	6,218,766,294円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	40,740,210円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	159,471,500円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	740,333,728円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	46,826,720円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	257,810,451円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	839,187,037円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	607,019,790円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,875,496,934円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	374,931円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	42,725,221円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	47,564,568円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	34,436,924円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	16,874,370円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	113,224,715円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	245,176,007円

SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	60,459,399円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	41,090,482円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	7,630,596円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	44,249,093円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	601,112,754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)	181,398,201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>	222,266,350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>	101,339,489円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	181,801,332円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	55,617,287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>	43,072,081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>	28,371,625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>	36,568,156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>	67,859,289円
SMDAM・日米3資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	12,284,348円
合計	63,261,805,196円

(2023年4月26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	63,261,805,196円
同期中における追加設定元本額	11,313,741,080円
同期中における一部解約元本額	7,813,130,820円
2023年4月26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	9,541,646,378円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	1,053,129,139円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,638,337,817円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,648,450,453円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	147,886,289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)	4,103,425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)	17,551,503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)	60,632,108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)	161,751,822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)	149,466,737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)	270,019,283円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,277,876,561円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	23,755,768,792円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	224,604,200円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	287,321,128円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	179,357,049円
イオン・バランス戦略ファンド	48,802,794円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	46,993,691円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	204,665,988円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	195,201,725円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	723,192,816円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	403,895,409円

三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	462,418,802円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	54,207,734円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	916,545,618円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	42,196,966円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	229,099,641円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	220,770,026円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	5,914,751円
日興FWS・日本株インデックス	1,553,047,725円
三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド	33,767,021円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	45,997円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	52,024円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	62,482円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	74,595円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	74,595円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	36,977円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	53,380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)	64,358円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	74,521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)	84,740円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,330,712,282円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	12,042,513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>	65,084,989円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	1,258,805,092円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	1,360,835,172円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	5,212,512,213円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	35,485,948円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	128,454,719円
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	625,303,090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>	42,743,164円
SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	227,367,598円
SMAM・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>	724,446,785円
SMAM・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>	505,587,630円
SMAM・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>	1,512,636,473円
SMAM・バランスVA株40T <適格機関投資家限定>	352,709円
SMAM・グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	33,786,896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>	88,502,143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>	47,497,470円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2 <適格機関投資家専用>	35,298,082円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2 <適格機関投資家専用>	7,431,986円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2 <適格機関投資家専用>	38,379,381円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2 <適格機関投資家専用>	486,166,361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)	158,733,909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>	179,946,203円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA <適格機関投資家限定>	78,463,864円

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>	76,811,589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>	38,854,455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>	51,538,394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>	37,247,656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>	48,176,456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>	442,012,325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>	17,181,246円
合 計	66,762,415,456円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

(単位:円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	4,100	3,505.000	14,370,500	
ニッスイ	109,600	583.000	63,896,800	
マルハニチロ	16,400	2,481.000	40,688,400	
雪国まいたけ	10,700	1,009.000	10,796,300	
カネコ種苗	4,700	1,586.000	7,454,200	
サカタのタネ	12,700	3,890.000	49,403,000	
ホクト	10,000	1,850.000	18,500,000	
住石ホールディングス	18,600	326.000	6,063,600	
日鉄鉱業	4,500	3,605.000	16,222,500	
三井松島ホールディングス	5,200	3,140.000	16,328,000	
I N P E X	407,400	1,449.000	590,322,600	
石油資源開発	12,700	4,460.000	56,642,000	
K & O エナジーグループ	5,400	2,430.000	13,122,000	
ショーボンドホールディングス	15,100	5,690.000	85,919,000	
ミライト・ワン	36,600	1,659.000	60,719,400	
タマホーム	7,100	3,635.000	25,808,500	
日本アクア	5,200	858.000	4,461,600	
R o b o t H o m e	21,600	232.000	5,011,200	
安藤・間	63,200	877.000	55,426,400	
東急建設	32,900	715.000	23,523,500	
コムシスホールディングス	37,000	2,531.000	93,647,000	
ビーアールホールディングス	21,600	371.000	8,013,600	
高松コンストラクショングループ	7,300	2,149.000	15,687,700	
東建コーポレーション	3,100	8,190.000	25,389,000	
ヤマウラ	6,800	1,209.000	8,221,200	
オリエンタル白石	42,800	326.000	13,952,800	
大成建設	76,900	4,500.000	346,050,000	
大林組	274,800	1,104.000	303,379,200	
清水建設	231,000	825.000	190,575,000	
飛島建設	9,600	1,098.000	10,540,800	

長谷工コーポレーション	79,100	1,615.000	127,746,500
松井建設	7,000	681.000	4,767,000
銭高組	1,900	3,250.000	6,175,000
鹿島建設	170,700	1,761.000	300,602,700
不動テトラ	5,300	1,742.000	9,232,600
鉄建建設	6,700	1,869.000	12,522,300
西松建設	13,400	3,530.000	47,302,000
三井住友建設	65,200	385.000	25,102,000
大豊建設	3,500	3,865.000	13,527,500
奥村組	12,500	3,300.000	41,250,000
東鉄工業	10,500	2,668.000	28,014,000
浅沼組	6,400	3,075.000	19,680,000
戸田建設	95,600	789.000	75,428,400
熊谷組	13,100	2,870.000	37,597,000
北野建設	2,300	3,135.000	7,210,500
矢作建設工業	11,000	829.000	9,119,000
ピーエス三菱	10,900	660.000	7,194,000
日本ハウスホールディングス	18,200	396.000	7,207,200
新日本建設	10,900	998.000	10,878,200
東亜道路工業	3,400	4,250.000	14,450,000
日本道路	1,700	7,730.000	13,141,000
東亜建設工業	7,000	2,835.000	19,845,000
日本国土開発	24,500	609.000	14,920,500
若築建設	3,600	4,130.000	14,868,000
東洋建設	25,800	968.000	24,974,400
五洋建設	110,700	646.000	71,512,200
世紀東急工業	11,100	955.000	10,600,500
福田組	3,100	4,705.000	14,585,500
住友林業	59,000	2,833.000	167,147,000
日本基礎技術	8,700	528.000	4,593,600
巴コーポレーション	13,000	426.000	5,538,000
大和ハウス工業	215,600	3,415.000	736,274,000
ライト工業	13,900	1,968.000	27,355,200
積水ハウス	241,600	2,746.500	663,554,400
日特建設	8,200	986.000	8,085,200
ユアテック	17,300	852.000	14,739,600
日本リーテック	6,300	1,134.000	7,144,200
四電工	3,600	1,899.000	6,836,400
中電工	10,900	2,194.000	23,914,600
関電工	40,500	974.000	39,447,000
きんでん	53,500	1,729.000	92,501,500
東京エネシス	8,900	900.000	8,010,000
トーエネック	2,800	3,390.000	9,492,000
住友電設	7,300	2,758.000	20,133,400
日本電設工業	12,500	1,683.000	21,037,500
エクシオグループ	35,100	2,480.000	87,048,000
新日本空調	4,400	1,905.000	8,382,000
九電工	19,000	3,465.000	65,835,000

三機工業	16,700	1,487.000	24,832,900
日揮ホールディングス	76,400	1,649.000	125,983,600
中外炉工業	3,300	1,789.000	5,903,700
ヤマト	8,200	904.000	7,412,800
太平電業	4,900	4,055.000	19,869,500
高砂熱学工業	18,500	2,212.000	40,922,000
三晃金属工業	1,300	4,105.000	5,336,500
朝日工業社	3,600	2,355.000	8,478,000
明星工業	14,400	924.000	13,305,600
大気社	8,800	3,590.000	31,592,000
ダイダン	5,200	2,404.000	12,500,800
日比谷総合設備	6,900	2,203.000	15,200,700
テスホールディングス	8,900	1,163.000	10,350,700
インフロニア・ホールディングス	80,800	1,044.000	84,355,200
東洋エンジニアリング	11,100	559.000	6,204,900
レイズネクスト	11,000	1,383.000	15,213,000
ニッポン	20,400	1,729.000	35,271,600
日清製粉グループ本社	71,500	1,617.000	115,615,500
日東富士製粉	1,900	4,460.000	8,474,000
昭和産業	6,500	2,627.000	17,075,500
鳥越製粉	11,200	617.000	6,910,400
中部飼料	10,900	1,058.000	11,532,200
フィード・ワン	12,600	690.000	8,694,000
日本甜菜製糖	5,400	1,714.000	9,255,600
D M三井製糖ホールディングス	7,600	2,238.000	17,008,800
ウェルネオシュガー	4,700	1,699.000	7,985,300
森永製菓	14,500	4,005.000	58,072,500
中村屋	2,800	3,155.000	8,834,000
江崎グリコ	22,200	3,420.000	75,924,000
井村屋グループ	4,600	2,285.000	10,511,000
不二家	5,300	2,468.000	13,080,400
山崎製パン	52,400	1,607.000	84,206,800
モロゾフ	2,700	3,570.000	9,639,000
亀田製菓	5,100	4,450.000	22,695,000
寿スピリッツ	8,300	10,190.000	84,577,000
カルビー	35,700	2,847.000	101,637,900
森永乳業	14,200	5,030.000	71,426,000
六甲バター	6,000	1,365.000	8,190,000
ヤクルト本社	55,400	10,070.000	557,878,000
明治ホールディングス	95,800	3,275.000	313,745,000
雪印メグミルク	18,600	1,918.000	35,674,800
プリマハム	10,300	2,284.000	23,525,200
日本ハム	30,200	3,950.000	119,290,000
丸大食品	8,700	1,519.000	13,215,300
S Foods	8,700	2,935.000	25,534,500
柿安本店	3,200	2,360.000	7,552,000
伊藤ハム米久ホールディングス	58,100	733.000	42,587,300
サッポロホールディングス	25,600	3,750.000	96,000,000

アサヒグループホールディングス	179,000	5,250.000	939,750,000
キリンホールディングス	349,700	2,224.500	777,907,650
宝ホールディングス	52,100	1,050.000	54,705,000
オエノンホールディングス	25,900	277.000	7,174,300
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	60,600	1,446.000	87,627,600
サントリー食品インターナショナル	54,500	4,995.000	272,227,500
ダイドーグループホールディングス	4,400	5,020.000	22,088,000
伊藤園	26,300	4,300.000	113,090,000
キーコーヒー	8,500	2,083.000	17,705,500
日清オイリオグループ	10,900	3,300.000	35,970,000
不二製油グループ本社	18,300	2,046.000	37,441,800
かどや製油	1,900	3,505.000	6,659,500
J - オイルミルズ	8,300	1,575.000	13,072,500
キッコーマン	51,200	7,110.000	364,032,000
味の素	189,800	4,822.000	915,215,600
ブルドックソース	3,600	1,972.000	7,099,200
キューピー	41,700	2,248.000	93,741,600
ハウス食品グループ本社	23,500	2,931.000	68,878,500
カゴメ	36,100	3,220.000	116,242,000
焼津水産化学工業	6,800	834.000	5,671,200
アリアケジャパン	6,800	5,400.000	36,720,000
エバラ食品工業	1,800	3,030.000	5,454,000
ニチレイ	35,700	2,760.000	98,532,000
東洋水産	39,300	5,860.000	230,298,000
イトアンドホールディングス	3,900	2,185.000	8,521,500
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,600	850.000	4,760,000
日清食品ホールディングス	27,200	13,000.000	353,600,000
永谷園ホールディングス	4,200	2,174.000	9,130,800
フジッコ	7,900	1,896.000	14,978,400
ロック・フィールド	8,700	1,545.000	13,441,500
日本たばこ産業	510,200	2,895.500	1,477,284,100
ケンコーマヨネーズ	6,000	1,230.000	7,380,000
わらべや日洋ホールディングス	6,200	2,303.000	14,278,600
なとり	5,300	1,989.000	10,541,700
ファーマフーズ	12,200	1,719.000	20,971,800
ユーグレナ	50,900	870.000	44,283,000
紀文食品	6,900	1,033.000	7,127,700
ピクルスホールディングス	5,200	1,142.000	5,938,400
ミヨシ油脂	3,800	997.000	3,788,600
理研ビタミン	7,200	1,980.000	14,256,000
片倉工業	8,800	1,780.000	15,664,000
グンゼ	6,100	4,630.000	28,243,000
東洋紡	34,900	1,013.000	35,353,700
ユニチカ	30,500	215.000	6,557,500
富士紡ホールディングス	3,400	3,150.000	10,710,000
倉敷紡績	6,300	2,472.000	15,573,600
シキボウ	6,400	1,004.000	6,425,600

日本毛織	21,400	986.000	21,100,400
帝国繊維	9,300	1,705.000	15,856,500
帝人	76,500	1,486.000	113,679,000
東レ	529,500	744.500	394,212,750
ダイニック	7,300	707.000	5,161,100
セーレン	15,400	2,210.000	34,034,000
小松マテーレ	13,300	674.000	8,964,200
ワコールホールディングス	15,400	2,626.000	40,440,400
ホギメディカル	10,900	3,325.000	36,242,500
T S Iホールディングス	28,000	639.000	17,892,000
ワールド	10,700	1,491.000	15,953,700
三陽商会	3,500	1,531.000	5,358,500
オンワードホールディングス	53,400	371.000	19,811,400
ルックホールディングス	2,900	2,197.000	6,371,300
ゴールドウイン	14,000	12,310.000	172,340,000
デサント	13,700	4,155.000	56,923,500
特種東海製紙	3,900	2,912.000	11,356,800
王子ホールディングス	328,300	526.000	172,685,800
日本製紙	42,500	1,064.000	45,220,000
北越コーポレーション	50,600	878.000	44,426,800
大王製紙	35,600	1,072.000	38,163,200
レンゴー	73,000	867.000	63,291,000
トーモク	5,400	1,571.000	8,483,400
ザ・パック	6,000	3,050.000	18,300,000
北の達人コーポレーション	35,900	303.000	10,877,700
クラレ	125,300	1,231.000	154,244,300
旭化成	491,400	935.800	459,852,120
レゾナック・ホールディングス	76,100	2,093.000	159,277,300
住友化学	583,600	453.000	264,370,800
住友精化	3,400	4,270.000	14,518,000
日産化学	37,300	5,930.000	221,189,000
ラサ工業	3,400	2,141.000	7,279,400
クレハ	6,700	8,330.000	55,811,000
多木化学	3,100	4,545.000	14,089,500
テイカ	5,800	1,187.000	6,884,600
石原産業	14,400	1,149.000	16,545,600
片倉コープアグリ	2,600	1,654.000	4,300,400
日本曹達	8,500	4,565.000	38,802,500
東ソー	104,700	1,778.000	186,156,600
トクヤマ	25,400	2,107.000	53,517,800
セントラル硝子	12,900	2,892.000	37,306,800
東亜合成	38,900	1,218.000	47,380,200
大阪ソーダ	4,800	4,295.000	20,616,000
関東電化工業	14,900	1,005.000	14,974,500
デンカ	28,800	2,674.000	77,011,200
信越化学工業	655,000	4,060.000	2,659,300,000
堺化学工業	6,100	1,801.000	10,986,100
第一稀元素化学工業	7,800	987.000	7,698,600

エア・ウォーター	74,100	1,669.000	123,672,900
日本酸素ホールディングス	76,200	2,412.000	183,794,400
日本化学工業	3,000	1,832.000	5,496,000
日本パーカラライジング	38,100	1,028.000	39,166,800
高压ガス工業	12,400	719.000	8,915,600
四国化成ホールディングス	9,700	1,369.000	13,279,300
戸田工業	2,000	2,420.000	4,840,000
ステラ ケミファ	4,800	2,636.000	12,652,800
保土谷化学工業	2,400	3,010.000	7,224,000
日本触媒	12,000	5,380.000	64,560,000
大日精化工業	5,700	1,830.000	10,431,000
カネカ	17,700	3,535.000	62,569,500
三菱瓦斯化学	57,900	1,932.000	111,862,800
三井化学	64,700	3,350.000	216,745,000
J S R	73,700	3,010.000	221,837,000
東京応化工業	13,800	6,980.000	96,324,000
大阪有機化学工業	6,000	1,986.000	11,916,000
三菱ケミカルグループ	532,600	778.800	414,788,880
K Hネオケム	13,100	2,291.000	30,012,100
ダイセル	116,300	1,033.000	120,137,900
住友ベークライト	11,500	5,120.000	58,880,000
積水化学工業	160,400	1,881.000	301,712,400
日本ゼオン	47,300	1,396.000	66,030,800
アイカ工業	19,800	3,025.000	59,895,000
U B E	40,100	2,124.000	85,172,400
積水樹脂	11,300	2,097.000	23,696,100
タキロンシーアイ	17,900	496.000	8,878,400
旭有機材	5,400	3,125.000	16,875,000
ニチバン	5,500	2,002.000	11,011,000
リケンテクノス	17,200	597.000	10,268,400
大倉工業	4,000	2,089.000	8,356,000
群栄化学工業	2,200	2,578.000	5,671,600
ミライアル	3,000	1,489.000	4,467,000
ダイキョーニシカワ	17,900	653.000	11,688,700
森六ホールディングス	4,300	1,901.000	8,174,300
恵和	5,200	1,336.000	6,947,200
日本化薬	59,400	1,198.000	71,161,200
カーリットホールディングス	8,700	686.000	5,968,200
日本精化	4,600	2,615.000	12,029,000
扶桑化学工業	7,200	3,650.000	26,280,000
トリケミカル研究所	10,600	2,165.000	22,949,000
A D E K A	26,800	2,216.000	59,388,800
日油	24,300	6,060.000	147,258,000
新日本理化	20,700	214.000	4,429,800
ハリマ化成グループ	6,400	867.000	5,548,800
花王	192,200	5,410.000	1,039,802,000
第一工業製薬	3,300	1,869.000	6,167,700
石原ケミカル	4,200	1,454.000	6,106,800

三洋化成工業	4,600	4,200.000	19,320,000
有機合成薬品工業	2,100	289.000	606,900
大日本塗料	10,800	842.000	9,093,600
日本ペイントホールディングス	349,000	1,229.000	428,921,000
関西ペイント	72,400	1,878.000	135,967,200
中国塗料	13,900	1,132.000	15,734,800
日本特殊塗料	5,700	961.000	5,477,700
藤倉化成	12,900	431.000	5,559,900
太陽ホールディングス	11,800	2,377.000	28,048,600
D I C	30,200	2,450.000	73,990,000
サカタインクス	17,500	1,081.000	18,917,500
東洋インキS Cホールディングス	14,900	2,155.000	32,109,500
T & K T O K A	7,700	1,146.000	8,824,200
富士フイルムホールディングス	151,500	6,900.000	1,045,350,000
資生堂	165,000	6,743.000	1,112,595,000
ライオン	95,500	1,466.000	140,003,000
高砂香料工業	5,400	2,545.000	13,743,000
マンダム	17,600	1,606.000	28,265,600
ミルボン	11,800	5,640.000	66,552,000
ファンケル	34,700	2,450.000	85,015,000
コーセー	16,100	15,770.000	253,897,000
コタ	7,400	1,639.000	12,128,600
ポーラ・オルビスホールディングス	40,700	1,830.000	74,481,000
ノエビアホールディングス	7,200	5,490.000	39,528,000
新日本製薬	4,900	1,422.000	6,967,800
アクシージア	4,300	1,072.000	4,609,600
エステー	6,900	1,586.000	10,943,400
アグロ カネショウ	3,900	1,727.000	6,735,300
コニシ	13,000	1,934.000	25,142,000
長谷川香料	16,300	3,170.000	51,671,000
小林製薬	23,000	8,540.000	196,420,000
荒川化学工業	8,000	974.000	7,792,000
メック	6,500	2,494.000	16,211,000
日本高純度化学	2,400	2,439.000	5,853,600
タカラバイオ	21,400	1,709.000	36,572,600
J C U	8,800	3,125.000	27,500,000
新田ゼラチン	6,000	805.000	4,830,000
O A Tアグリオ	3,400	1,319.000	4,484,600
デクセリアルズ	22,900	2,497.000	57,181,300
アース製薬	7,200	4,905.000	35,316,000
北興化学工業	10,200	902.000	9,200,400
大成ラミック	3,500	2,867.000	10,034,500
クミアイ化学工業	32,200	882.000	28,400,400
日本農薬	15,600	675.000	10,530,000
アキレス	6,000	1,429.000	8,574,000
有沢製作所	13,200	1,229.000	16,222,800
日東電工	57,100	8,270.000	472,217,000
レック	12,400	841.000	10,428,400

三光合成	11,500	509.000	5,853,500
きもと	21,600	189.000	4,082,400
藤森工業	6,000	3,045.000	18,270,000
前澤化成工業	6,000	1,623.000	9,738,000
未来工業	3,300	1,798.000	5,933,400
J S P	5,800	1,545.000	8,961,000
エフピコ	15,300	3,290.000	50,337,000
天馬	6,600	2,292.000	15,127,200
信越ポリマー	14,400	1,449.000	20,865,600
東リ	20,900	271.000	5,663,900
ニフコ	28,400	3,755.000	106,642,000
バルカー	6,700	3,350.000	22,445,000
ユニ・チャーム	164,700	5,485.000	903,379,500
協和キリン	95,100	3,020.000	287,202,000
武田薬品工業	698,600	4,517.000	3,155,576,200
アステラス製薬	756,500	1,989.500	1,505,056,750
住友ファーマ	58,800	849.000	49,921,200
塩野義製薬	99,600	6,103.000	607,858,800
日本新薬	18,600	6,140.000	114,204,000
中外製薬	247,000	3,415.000	843,505,000
科研製薬	13,400	3,715.000	49,781,000
エーザイ	96,200	7,625.000	733,525,000
ロート製薬	76,600	2,805.000	214,863,000
小野薬品工業	152,400	2,723.500	415,061,400
久光製薬	17,600	3,720.000	65,472,000
持田製薬	9,300	3,420.000	31,806,000
参天製薬	148,400	1,094.000	162,349,600
扶桑薬品工業	3,000	2,049.000	6,147,000
ツムラ	24,800	2,720.000	67,456,000
キッセイ薬品工業	12,200	2,680.000	32,696,000
生化学工業	15,200	823.000	12,509,600
栄研化学	13,000	1,556.000	20,228,000
鳥居薬品	4,200	3,385.000	14,217,000
J C R ファーマ	27,100	1,443.000	39,105,300
東和薬品	12,200	1,904.000	23,228,800
富士製薬工業	6,000	1,234.000	7,404,000
ゼリア新薬工業	11,000	2,395.000	26,345,000
第一三共	687,900	4,709.000	3,239,321,100
杏林製薬	16,700	1,724.000	28,790,800
大幸薬品	16,800	378.000	6,350,400
ダイト	5,700	2,528.000	14,409,600
大塚ホールディングス	180,500	4,541.000	819,650,500
大正製薬ホールディングス	17,900	5,740.000	102,746,000
ペプチドリーム	38,700	1,803.000	69,776,100
あすか製薬ホールディングス	8,500	1,258.000	10,693,000
サワイグループホールディングス	18,100	3,835.000	69,413,500
日本コークス工業	83,300	90.000	7,497,000
ニチレキ	9,600	1,670.000	16,032,000

ユシロ化学工業	8,500	848.000	7,208,000
富士石油	22,100	266.000	5,878,600
出光興産	87,400	2,837.000	247,953,800
E N E O Sホールディングス	1,338,500	475.600	636,590,600
コスモエネルギーホールディングス	31,300	4,265.000	133,494,500
横浜ゴム	44,800	2,828.000	126,694,400
T O Y O T I R E	45,100	1,569.000	70,761,900
ブリヂストン	251,900	5,322.000	1,340,611,800
住友ゴム工業	77,600	1,211.000	93,973,600
藤倉コンポジット	5,500	999.000	5,494,500
オカモト	4,500	3,995.000	17,977,500
フコク	5,400	1,029.000	5,556,600
ニッタ	7,800	3,005.000	23,439,000
住友理工	16,300	683.000	11,132,900
三ツ星ベルト	11,500	3,830.000	44,045,000
バンドー化学	12,900	1,069.000	13,790,100
日東紡績	9,500	1,866.000	17,727,000
A G C	80,300	4,990.000	400,697,000
日本電気硝子	32,500	2,551.000	82,907,500
オハラ	5,500	1,127.000	6,198,500
住友大阪セメント	11,600	3,725.000	43,210,000
太平洋セメント	50,600	2,416.000	122,249,600
日本ヒューム	9,800	769.000	7,536,200
日本コンクリート工業	22,500	253.000	5,692,500
三谷セキサン	3,600	4,645.000	16,722,000
アジアパイルホールディングス	14,000	720.000	10,080,000
東海カーボン	66,800	1,196.000	79,892,800
日本カーボン	4,900	4,110.000	20,139,000
東洋炭素	5,300	3,965.000	21,014,500
ノリタケカンパニーリミテド	4,200	4,570.000	19,194,000
T O T O	52,100	4,555.000	237,315,500
日本碍子	93,200	1,751.000	163,193,200
日本特殊陶業	60,300	2,763.000	166,608,900
ダントーホールディングス	6,600	638.000	4,210,800
M A R U W A	3,100	16,760.000	51,956,000
品川リフラクトリーズ	2,400	4,530.000	10,872,000
黒崎播磨	1,800	6,000.000	10,800,000
ヨータイ	5,900	1,473.000	8,690,700
東京窯業	5,500	337.000	1,853,500
フジインコーポレーテッド	6,500	6,880.000	44,720,000
ニチアス	21,000	2,681.000	56,301,000
ニチハ	11,000	2,770.000	30,470,000
日本製鉄	363,500	2,857.500	1,038,701,250
神戸製鋼所	163,400	1,002.000	163,726,800
中山製鋼所	17,400	865.000	15,051,000
合同製鐵	4,300	2,952.000	12,693,600
J F Eホールディングス	216,500	1,575.000	340,987,500
東京製鐵	22,900	1,313.000	30,067,700

共英製鋼	9,400	1,625.000	15,275,000
大和工業	13,300	5,220.000	69,426,000
東京鐵鋼	4,400	1,792.000	7,884,800
大阪製鐵	5,300	1,225.000	6,492,500
淀川製鋼所	9,000	2,756.000	24,804,000
中部鋼鈹	7,000	2,003.000	14,021,000
丸一鋼管	24,600	2,995.000	73,677,000
モリ工業	2,100	3,440.000	7,224,000
大同特殊鋼	10,200	5,170.000	52,734,000
日本冶金工業	6,100	3,895.000	23,759,500
山陽特殊製鋼	7,900	2,328.000	18,391,200
愛知製鋼	5,200	2,375.000	12,350,000
大平洋金属	6,100	1,844.000	11,248,400
新日本電工	54,100	337.000	18,231,700
栗本鐵工所	4,600	1,987.000	9,140,200
三菱製鋼	5,800	1,111.000	6,443,800
日本精線	1,300	4,470.000	5,811,000
新家工業	2,500	2,046.000	5,115,000
大紀アルミニウム工業所	11,700	1,351.000	15,806,700
日本輕金属ホールディングス	22,200	1,408.000	31,257,600
三井金属鈹業	23,500	3,190.000	74,965,000
東邦亜鉛	5,200	1,834.000	9,536,800
三菱マテリアル	54,600	2,195.000	119,847,000
住友金属鈹山	94,300	5,000.000	471,500,000
D O W Aホールディングス	18,300	4,325.000	79,147,500
古河機械金属	12,500	1,326.000	16,575,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	12,100	2,857.000	34,569,700
東邦チタニウム	15,000	2,031.000	30,465,000
U A C J	11,500	2,665.000	30,647,500
C Kサンエツ	2,200	4,150.000	9,130,000
古河電氣工業	27,400	2,422.000	66,362,800
住友電氣工業	280,600	1,674.000	469,724,400
フジクラ	87,800	901.000	79,107,800
S W C C	9,500	1,720.000	16,340,000
平河ヒューテック	5,200	1,410.000	7,332,000
リョービ	9,300	1,522.000	14,154,600
アーレスティ	10,100	525.000	5,302,500
アサヒホールディングス	33,200	2,023.000	67,163,600
稲葉製作所	6,800	1,426.000	9,696,800
宮地エンジニアリンググループ	2,500	3,810.000	9,525,000
トーカロ	21,800	1,243.000	27,097,400
アルファ	6,000	974.000	5,844,000
S U M C O	154,500	1,861.000	287,524,500
川田テクノロジーズ	2,300	4,020.000	9,246,000
R S T E C H N O L O G I E S	5,600	2,992.000	16,755,200
ジェイテックコーポレーション	1,300	2,508.000	3,260,400
信和	9,300	714.000	6,640,200
東洋製罐グループホールディングス	54,000	1,876.000	101,304,000

ホッカンホールディングス	5,800	1,378.000	7,992,400
横河ブリッジホールディングス	10,100	2,184.000	22,058,400
三和ホールディングス	74,500	1,440.000	107,280,000
文化シャッター	23,500	1,116.000	26,226,000
三協立山	10,700	672.000	7,190,400
アルインコ	7,600	1,007.000	7,653,200
L I X I L	118,300	2,065.000	244,289,500
ノーリツ	12,000	1,814.000	21,768,000
長府製作所	8,300	2,362.000	19,604,600
リンナイ	44,100	3,195.000	140,899,500
日東精工	12,800	595.000	7,616,000
岡部	14,100	819.000	11,547,900
ジーテクト	9,300	1,421.000	13,215,300
東ブレ	14,300	1,297.000	18,547,100
高周波熱錬	13,700	717.000	9,822,900
東京製網	5,400	1,128.000	6,091,200
パイオラックス	11,400	1,962.000	22,366,800
エイチワン	9,600	648.000	6,220,800
日本発条	71,800	961.000	68,999,800
立川ブラインド工業	4,500	1,287.000	5,791,500
三益半導体工業	6,200	2,652.000	16,442,400
日本製鋼所	22,100	2,402.000	53,084,200
三浦工業	33,200	3,525.000	117,030,000
タクマ	24,600	1,350.000	33,210,000
ツガミ	17,700	1,370.000	24,249,000
オークマ	7,800	5,870.000	45,786,000
芝浦機械	8,000	3,025.000	24,200,000
アマダ	125,300	1,231.000	154,244,300
アイダエンジニアリング	17,000	836.000	14,212,000
F U J I	34,200	2,201.000	75,274,200
牧野フライス製作所	8,700	4,740.000	41,238,000
オーエスジー	37,800	1,865.000	70,497,000
旭ダイヤモンド工業	22,600	899.000	20,317,400
D M G 森精機	47,900	2,107.000	100,925,300
ソディック	22,400	742.000	16,620,800
ディスコ	38,400	15,570.000	597,888,000
日東工器	4,400	1,911.000	8,408,400
日進工具	6,800	1,109.000	7,541,200
富士ダイス	4,100	725.000	2,972,500
豊和工業	5,500	846.000	4,653,000
石川製作所	3,600	1,412.000	5,083,200
島精機製作所	12,400	1,807.000	22,406,800
オプトラン	12,100	2,049.000	24,792,900
N C ホールディングス	2,200	1,781.000	3,918,200
イワキ	6,300	1,267.000	7,982,100
フリーー	8,900	1,134.000	10,092,600
ヤマシンフィルタ	21,800	330.000	7,194,000
日阪製作所	8,800	907.000	7,981,600

やまびこ	13,300	1,308.000	17,396,400
野村マイクロ・サイエンス	2,700	3,750.000	10,125,000
平田機工	3,800	6,570.000	24,966,000
P E G A S U S	10,400	614.000	6,385,600
マルマエ	4,300	1,590.000	6,837,000
タツモ	4,700	1,821.000	8,558,700
ナブテスコ	49,900	3,105.000	154,939,500
三井海洋開発	10,300	1,398.000	14,399,400
レオン自動機	8,800	1,240.000	10,912,000
S M C	25,800	66,920.000	1,726,536,000
ホソカワミクロン	6,100	2,893.000	17,647,300
ユニオンツール	3,400	3,185.000	10,829,000
オイレス工業	10,900	1,687.000	18,388,300
日精エー・エス・ビー機械	3,700	4,150.000	15,355,000
サトーホールディングス	11,300	2,241.000	25,323,300
技研製作所	8,300	2,110.000	17,513,000
日本エアーテック	5,100	1,088.000	5,548,800
日精樹脂工業	6,900	994.000	6,858,600
ワイエイシイホールディングス	3,200	2,562.000	8,198,400
小松製作所	372,400	3,232.000	1,203,596,800
住友重機械工業	46,600	3,190.000	148,654,000
日立建機	31,500	3,130.000	98,595,000
日工	13,700	641.000	8,781,700
巴工業	4,000	2,433.000	9,732,000
井関農機	8,400	1,177.000	9,886,800
T O W A	8,100	1,976.000	16,005,600
ローツェ	4,100	10,420.000	42,722,000
クボタ	420,600	1,990.000	836,994,000
荏原実業	4,100	2,945.000	12,074,500
三菱化工機	2,900	2,372.000	6,878,800
月島ホールディングス	11,500	1,080.000	12,420,000
帝国電機製作所	5,900	2,351.000	13,870,900
新東工業	16,900	976.000	16,494,400
澁谷工業	7,300	2,432.000	17,753,600
アイチコーポレーション	11,900	819.000	9,746,100
小森コーポレーション	19,200	1,002.000	19,238,400
鶴見製作所	6,600	2,218.000	14,638,800
酒井重工業	1,500	4,025.000	6,037,500
荏原製作所	32,400	5,850.000	189,540,000
西島製作所	7,600	1,543.000	11,726,800
北越工業	8,700	1,349.000	11,736,300
ダイキン工業	94,900	23,540.000	2,233,946,000
オルガノ	10,900	3,200.000	34,880,000
トーヨーカネツ	3,400	2,672.000	9,084,800
栗田工業	44,400	5,760.000	255,744,000
椿本チエイン	10,900	3,280.000	35,752,000
大同工業	6,700	752.000	5,038,400
木村化工機	8,700	694.000	6,037,800

アネスト岩田	14,100	1,001.000	14,114,100
ダイフク	122,700	2,418.000	296,688,600
サムコ	2,700	4,995.000	13,486,500
加藤製作所	4,800	1,136.000	5,452,800
タダノ	42,000	1,022.000	42,924,000
フジテック	28,000	3,510.000	98,280,000
C K D	21,700	2,010.000	43,617,000
平和	26,900	2,642.000	71,069,800
理想科学工業	7,300	2,416.000	17,636,800
S A N K Y O	15,800	5,840.000	92,272,000
日本金銭機械	9,600	1,217.000	11,683,200
マースグループホールディングス	5,000	3,050.000	15,250,000
フクシマガリレイ	5,900	4,935.000	29,116,500
ダイコク電機	4,700	2,998.000	14,090,600
竹内製作所	14,400	3,540.000	50,976,000
アマノ	22,700	2,722.000	61,789,400
J U K I	13,700	623.000	8,535,100
ジャノメ	9,400	615.000	5,781,000
マックス	9,700	2,126.000	20,622,200
グローリー	19,400	2,837.000	55,037,800
新晃工業	8,400	1,746.000	14,666,400
大和冷機工業	12,300	1,403.000	17,256,900
セガサミーホールディングス	64,200	2,523.000	161,976,600
リケン	3,500	2,652.000	9,282,000
T P R	9,200	1,345.000	12,374,000
ツバキ・ナカシマ	20,300	920.000	18,676,000
ホシザキ	51,200	4,715.000	241,408,000
大豊工業	8,300	694.000	5,760,200
日本精工	145,100	739.000	107,228,900
N T N	157,500	320.000	50,400,000
ジェイテクト	70,200	1,025.000	71,955,000
不二越	5,800	3,760.000	21,808,000
日本トムソン	20,600	579.000	11,927,400
T H K	45,700	2,966.000	135,546,200
ユーシン精機	7,700	778.000	5,990,600
前澤給装工業	6,800	1,030.000	7,004,000
イーグル工業	9,000	1,257.000	11,313,000
前澤工業	8,400	716.000	6,014,400
日本ピラー工業	7,300	3,645.000	26,608,500
キッツ	29,800	899.000	26,790,200
マキタ	99,000	3,090.000	305,910,000
日立造船	65,700	854.000	56,107,800
三菱重工業	139,200	5,043.000	701,985,600
I H I	50,100	3,335.000	167,083,500
スター精密	14,800	1,714.000	25,367,200
日清紡ホールディングス	65,400	1,020.000	66,708,000
イビデン	45,700	4,920.000	224,844,000
コニカミノルタ	178,400	547.000	97,584,800

ブラザー工業	106,100	2,054.000	217,929,400
ミネベアミツミ	137,800	2,406.000	331,546,800
日立製作所	386,600	7,586.000	2,932,747,600
東芝	153,400	4,403.000	675,420,200
三菱電機	821,900	1,658.000	1,362,710,200
富士電機	48,200	4,995.000	240,759,000
東洋電機製造	6,800	1,029.000	6,997,200
安川電機	94,200	5,430.000	511,506,000
シンフォニア テクノロジー	9,100	1,671.000	15,206,100
明電舎	12,500	1,814.000	22,675,000
オリジン	3,700	1,236.000	4,573,200
山洋電気	3,600	6,070.000	21,852,000
デンヨー	6,800	1,765.000	12,002,000
PHCホールディングス	11,300	1,431.000	16,170,300
ソシオネクスト	8,200	10,870.000	89,134,000
東芝テック	12,100	3,815.000	46,161,500
芝浦メカトロニクス	1,500	15,160.000	22,740,000
マブチモーター	19,700	4,035.000	79,489,500
ニデック	193,500	6,559.000	1,269,166,500
トレックス・セミコンダクター	4,100	2,203.000	9,032,300
東光高岳	5,100	2,178.000	11,107,800
ダブル・スコープ	26,400	1,106.000	29,198,400
ダイヘン	7,200	4,370.000	31,464,000
ヤーマン	14,500	1,180.000	17,110,000
JVCケンウッド	75,400	386.000	29,104,400
ミマキエンジニアリング	9,000	640.000	5,760,000
I - P E X	5,300	1,366.000	7,239,800
大崎電気工業	22,500	543.000	12,217,500
オムロン	72,800	7,622.000	554,881,600
日東工業	11,000	2,649.000	29,139,000
I D E C	12,000	3,190.000	38,280,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	26,300	2,220.000	58,386,000
メルコホールディングス	2,400	3,315.000	7,956,000
日本電気	112,500	5,050.000	568,125,000
富士通	79,200	18,225.000	1,443,420,000
沖電気工業	37,900	725.000	27,477,500
電気興業	3,800	2,262.000	8,595,600
サンケン電気	7,400	10,020.000	74,148,000
アイホン	5,400	2,086.000	11,264,400
ルネサスエレクトロニクス	519,000	1,774.500	920,965,500
セイコーエプソン	105,800	1,985.000	210,013,000
ワコム	60,900	660.000	40,194,000
アルバック	18,900	5,350.000	101,115,000
アクセル	3,200	1,467.000	4,694,400
E I Z O	6,000	4,360.000	26,160,000
日本信号	18,900	1,092.000	20,638,800
京三製作所	20,700	421.000	8,714,700
能美防災	11,200	1,721.000	19,275,200

ホーチキ	6,800	1,566.000	10,648,800
エレコム	19,500	1,258.000	24,531,000
パナソニック ホールディングス	939,700	1,278.500	1,201,406,450
シャープ	96,400	942.000	90,808,800
アンリツ	57,000	1,219.000	69,483,000
富士通ゼネラル	22,700	3,730.000	84,671,000
ソニーグループ	556,900	12,140.000	6,760,766,000
T D K	125,900	4,515.000	568,438,500
帝国通信工業	4,500	1,528.000	6,876,000
タムラ製作所	35,200	764.000	26,892,800
アルプスアルパイン	71,600	1,199.000	85,848,400
日本電波工業	10,200	1,145.000	11,679,000
鈴木	5,500	994.000	5,467,000
メイコー	8,800	2,633.000	23,170,400
日本トリム	2,200	2,903.000	6,386,600
ローランド ディー . ジー .	4,600	3,340.000	15,364,000
フォスター電機	8,400	1,116.000	9,374,400
S M K	2,500	2,443.000	6,107,500
ヨコオ	6,800	1,943.000	13,212,400
ホシデン	19,100	1,705.000	32,565,500
ヒロセ電機	13,200	17,900.000	236,280,000
日本航空電子工業	16,400	2,346.000	38,474,400
T O A	10,900	836.000	9,112,400
マクセル	17,800	1,487.000	26,468,600
古野電気	11,700	920.000	10,764,000
スミダコーポレーション	7,800	1,666.000	12,994,800
アイコム	3,700	2,726.000	10,086,200
リオン	3,800	1,949.000	7,406,200
横河電機	87,000	2,137.000	185,919,000
新電元工業	3,300	3,375.000	11,137,500
アズビル	55,100	3,650.000	201,115,000
東亜ディーケーケー	7,900	789.000	6,233,100
日本光電工業	36,700	3,680.000	135,056,000
チノー	4,000	2,078.000	8,312,000
日本電子材料	6,300	1,385.000	8,725,500
堀場製作所	17,600	7,440.000	130,944,000
アドバンテスト	62,000	11,620.000	720,440,000
エスベック	6,700	1,988.000	13,319,600
キーエンス	78,800	61,610.000	4,854,868,000
日置電機	4,200	9,000.000	37,800,000
シスメックス	68,000	8,817.000	599,556,000
日本マイクロニクス	13,200	1,224.000	16,156,800
メガチップス	6,600	3,175.000	20,955,000
O B A R A G R O U P	4,300	4,045.000	17,393,500
コーセル	10,600	1,056.000	11,193,600
イリソ電子工業	7,400	4,490.000	33,226,000
オブテックスグループ	14,700	1,953.000	28,709,100
千代田インテグレ	4,100	2,298.000	9,421,800

レーザーテック	36,100	19,495.000	703,769,500
スタンレー電気	55,900	2,828.000	158,085,200
ウシオ電機	40,300	1,645.000	66,293,500
ヘリオス テクノ ホールディング	11,900	686.000	8,163,400
エノモト	2,500	1,644.000	4,110,000
日本セラミック	8,200	2,647.000	21,705,400
古河電池	6,600	1,109.000	7,319,400
山一電機	7,300	1,772.000	12,935,600
図研	7,100	3,335.000	23,678,500
日本電子	19,800	3,870.000	76,626,000
カシオ計算機	59,000	1,263.000	74,517,000
ファナック	386,500	4,493.000	1,736,544,500
日本シイエムケイ	19,800	444.000	8,791,200
エンプラス	2,500	4,530.000	11,325,000
大真空	10,800	679.000	7,333,200
ローム	36,400	10,290.000	374,556,000
浜松ホトニクス	63,000	7,080.000	446,040,000
三井ハイテック	8,100	7,690.000	62,289,000
新光電気工業	27,900	3,665.000	102,253,500
京セラ	122,400	6,905.000	845,172,000
太陽誘電	38,300	4,010.000	153,583,000
村田製作所	238,600	7,630.000	1,820,518,000
双葉電子工業	18,700	517.000	9,667,900
北陸電気工業	3,000	1,202.000	3,606,000
ニチコン	16,400	1,265.000	20,746,000
日本ケミコン	8,100	1,988.000	16,102,800
K O A	12,300	1,619.000	19,913,700
市光工業	13,000	526.000	6,838,000
小糸製作所	94,300	2,426.000	228,771,800
ミツバ	16,200	560.000	9,072,000
S C R E E Nホールディングス	13,500	10,950.000	147,825,000
キヤノン電子	9,200	1,818.000	16,725,600
キヤノン	432,200	3,006.000	1,299,193,200
リコー	197,900	1,076.000	212,940,400
象印マホービン	23,900	1,716.000	41,012,400
東京エレクトロン	166,500	15,260.000	2,540,790,000
イノテック	6,200	1,351.000	8,376,200
トヨタ紡織	33,000	2,085.000	68,805,000
ユニプレス	15,100	901.000	13,605,100
豊田自動織機	57,500	7,580.000	435,850,000
モリタホールディングス	14,700	1,382.000	20,315,400
三櫻工業	12,500	668.000	8,350,000
デンソー	162,200	7,524.000	1,220,392,800
東海理化電機製作所	21,800	1,655.000	36,079,000
川崎重工業	59,500	2,881.000	171,419,500
日本車輛製造	3,900	2,049.000	7,991,100
三菱ロジスネクスト	14,000	941.000	13,174,000
日産自動車	1,118,500	475.700	532,070,450

いすゞ自動車	228,100	1,531.000	349,221,100
トヨタ自動車	4,322,700	1,803.500	7,795,989,450
日野自動車	102,100	551.000	56,257,100
三菱自動車工業	308,600	493.000	152,139,800
武蔵精密工業	19,200	1,680.000	32,256,000
日産車体	14,800	929.000	13,749,200
新明和工業	25,400	1,189.000	30,200,600
極東開発工業	14,100	1,684.000	23,744,400
トピー工業	7,100	1,808.000	12,836,800
ティラド	2,500	2,295.000	5,737,500
曙ブレーキ工業	56,900	145.000	8,250,500
タチエス	13,200	1,178.000	15,549,600
N O K	30,900	1,771.000	54,723,900
フタバ産業	23,000	438.000	10,074,000
K Y B	7,500	4,115.000	30,862,500
大同メタル工業	19,500	513.000	10,003,500
プレス工業	35,400	525.000	18,585,000
ミクニ	14,000	332.000	4,648,000
太平洋工業	18,200	1,141.000	20,766,200
アイシン	60,400	3,680.000	222,272,000
マツダ	260,500	1,168.000	304,264,000
今仙電機製作所	6,300	722.000	4,548,600
本田技研工業	639,800	3,476.000	2,223,944,800
スズキ	144,600	4,585.000	662,991,000
S U B A R U	249,500	2,107.000	525,696,500
安永	3,600	996.000	3,585,600
ヤマハ発動機	123,400	3,415.000	421,411,000
エクセディ	13,000	1,887.000	24,531,000
豊田合成	22,800	2,197.000	50,091,600
愛三工業	13,800	852.000	11,757,600
日本プラスト	14,400	406.000	5,846,400
ヨロズ	8,700	861.000	7,490,700
エフ・シー・シー	13,700	1,675.000	22,947,500
シマノ	32,200	20,000.000	644,000,000
テイ・エス テック	35,900	1,732.000	62,178,800
ジャムコ	4,400	1,324.000	5,825,600
テルモ	242,100	3,980.000	963,558,000
日機装	18,800	933.000	17,540,400
日本エム・ディ・エム	5,500	994.000	5,467,000
島津製作所	95,600	4,155.000	397,218,000
長野計器	6,100	1,268.000	7,734,800
ブイ・テクノロジー	4,100	2,985.000	12,238,500
東京計器	7,100	1,198.000	8,505,800
愛知時計電機	3,900	1,545.000	6,025,500
インターアクション	4,100	1,309.000	5,366,900
オーバル	8,300	431.000	3,577,300
東京精密	17,200	5,030.000	86,516,000
マニー	35,000	1,768.000	61,880,000

ニコン	122,500	1,336.000	163,660,000
トプコン	41,300	1,876.000	77,478,800
オリンパス	492,200	2,359.500	1,161,345,900
理研計器	4,900	5,050.000	24,745,000
タムロン	5,900	3,195.000	18,850,500
HOYA	168,100	14,105.000	2,371,050,500
ノーリツ鋼機	7,700	2,176.000	16,755,200
A & D ホロンホールディングス	11,400	1,326.000	15,116,400
朝日インテック	88,000	2,384.000	209,792,000
シチズン時計	87,000	739.000	64,293,000
リズム	2,700	1,956.000	5,281,200
メニコン	27,300	2,814.000	76,822,200
松風	4,000	2,066.000	8,264,000
セイコーグループ	12,400	2,863.000	35,501,200
ニプロ	66,700	1,009.000	67,300,300
スノーピーク	13,800	2,057.000	28,386,600
パラマウントベッドホールディングス	18,200	2,361.000	42,970,200
トランザクション	6,500	1,659.000	10,783,500
ニホンフラッシュ	8,000	1,011.000	8,088,000
前田工織	6,800	3,190.000	21,692,000
永大産業	24,100	220.000	5,302,000
アートネイチャー	9,200	771.000	7,093,200
バンダイナムコホールディングス	215,400	2,995.500	645,230,700
SHOEI	16,600	2,486.000	41,267,600
フランスベッドホールディングス	10,500	1,057.000	11,098,500
パイロットコーポレーション	12,400	4,455.000	55,242,000
萩原工業	6,300	1,344.000	8,467,200
フジシールインターナショナル	16,000	1,497.000	23,952,000
タカラトミー	36,300	1,487.000	53,978,100
広済堂ホールディングス	5,000	2,599.000	12,995,000
プロネクサス	7,100	981.000	6,965,100
ウッドワン	3,200	1,123.000	3,593,600
大建工業	5,000	2,297.000	11,485,000
凸版印刷	102,700	2,783.000	285,814,100
大日本印刷	93,500	3,815.000	356,702,500
共同印刷	2,800	2,782.000	7,789,600
NISSHA	15,000	1,776.000	26,640,000
TAKARA & COMPANY	5,600	2,345.000	13,132,000
アシックス	72,700	3,765.000	273,715,500
ツツミ	2,200	2,210.000	4,862,000
ローランド	6,000	3,865.000	23,190,000
小松ウオール工業	3,100	2,000.000	6,200,000
ヤマハ	49,300	5,160.000	254,388,000
河合楽器製作所	2,200	3,055.000	6,721,000
クリナップ	9,700	746.000	7,236,200
ビジョン	50,600	2,062.000	104,337,200
キングジム	8,000	915.000	7,320,000
リンテック	15,400	2,196.000	33,818,400

イトーキ	17,100	765.000	13,081,500
任天堂	497,100	5,618.000	2,792,707,800
三菱鉛筆	11,100	1,713.000	19,014,300
タカラスタANDARD	15,000	1,605.000	24,075,000
コクヨ	37,800	1,894.000	71,593,200
グローブライド	6,300	2,397.000	15,101,100
オカムラ	23,600	1,393.000	32,874,800
美津濃	7,900	3,320.000	26,228,000
東京電力ホールディングス	710,600	479.000	340,377,400
中部電力	289,100	1,475.000	426,422,500
関西電力	303,300	1,336.000	405,208,800
中国電力	125,900	702.000	88,381,800
北陸電力	75,300	638.000	48,041,400
東北電力	193,100	707.000	136,521,700
四国電力	67,300	791.000	53,234,300
九州電力	180,100	805.000	144,980,500
北海道電力	75,900	512.000	38,860,800
沖縄電力	19,400	1,093.000	21,204,200
電源開発	59,400	2,157.000	128,125,800
エフオン	6,200	637.000	3,949,400
イーレックス	14,100	1,717.000	24,209,700
レノバ	21,200	1,913.000	40,555,600
東京瓦斯	166,500	2,701.000	449,716,500
大阪瓦斯	159,300	2,197.000	349,982,100
東邦瓦斯	31,000	2,515.000	77,965,000
北海道瓦斯	5,100	1,916.000	9,771,600
広島ガス	18,900	355.000	6,709,500
西部ガスホールディングス	7,200	1,820.000	13,104,000
静岡ガス	17,800	1,154.000	20,541,200
メタウォーター	9,700	1,823.000	17,683,100
SBSホールディングス	7,000	3,265.000	22,855,000
東武鉄道	86,100	3,435.000	295,753,500
相鉄ホールディングス	26,100	2,437.000	63,605,700
東急	219,900	1,902.000	418,249,800
京浜急行電鉄	89,500	1,318.000	117,961,000
小田急電鉄	118,900	1,879.000	223,413,100
京王電鉄	41,600	5,040.000	209,664,000
京成電鉄	50,600	4,715.000	238,579,000
富士急行	9,800	5,130.000	50,274,000
東日本旅客鉄道	133,600	7,782.000	1,039,675,200
西日本旅客鉄道	100,800	5,949.000	599,659,200
東海旅客鉄道	60,700	16,745.000	1,016,421,500
西武ホールディングス	95,500	1,549.000	147,929,500
鴻池運輸	13,600	1,585.000	21,556,000
西日本鉄道	20,800	2,465.000	51,272,000
ハマキョウレックス	6,100	3,380.000	20,618,000
サカイ引越センター	3,800	4,735.000	17,993,000
近鉄グループホールディングス	78,400	4,550.000	356,720,000

阪急阪神ホールディングス	104,300	4,210.000	439,103,000
南海電気鉄道	37,600	3,100.000	116,560,000
京阪ホールディングス	32,600	3,710.000	120,946,000
神戸電鉄	2,800	3,190.000	8,932,000
名古屋鉄道	86,800	2,159.000	187,401,200
山陽電気鉄道	6,600	2,354.000	15,536,400
アルプス物流	6,400	1,298.000	8,307,200
ヤマトホールディングス	100,700	2,301.000	231,710,700
山九	20,000	4,720.000	94,400,000
丸全昭和運輸	4,900	3,345.000	16,390,500
センコーグループホールディングス	41,200	960.000	39,552,000
トナミホールディングス	1,900	4,415.000	8,388,500
ニッコンホールディングス	24,800	2,560.000	63,488,000
福山通運	6,100	3,610.000	22,021,000
セイノーホールディングス	48,900	1,483.000	72,518,700
神奈川中央交通	2,700	3,250.000	8,775,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	19,300	1,956.000	37,750,800
C & F ロジホールディングス	7,900	1,256.000	9,922,400
九州旅客鉄道	55,700	3,095.000	172,391,500
S Gホールディングス	150,700	1,917.000	288,891,900
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	29,200	7,820.000	228,344,000
日本郵船	209,800	3,197.000	670,730,600
商船三井	137,900	3,350.000	461,965,000
川崎汽船	66,900	3,215.000	215,083,500
N S ユナイテッド海運	4,300	4,235.000	18,210,500
明治海運	9,400	621.000	5,837,400
飯野海運	29,600	1,017.000	30,103,200
乾汽船	10,800	1,720.000	18,576,000
日本航空	192,800	2,579.000	497,231,200
A N Aホールディングス	214,800	2,930.000	629,364,000
トランコム	2,400	7,470.000	17,928,000
日新	6,300	2,073.000	13,059,900
三菱倉庫	16,700	3,270.000	54,609,000
三井倉庫ホールディングス	7,300	3,980.000	29,054,000
住友倉庫	21,000	2,257.000	47,397,000
澁澤倉庫	3,200	2,276.000	7,283,200
東陽倉庫	19,100	277.000	5,290,700
日本トランスシティ	15,800	654.000	10,333,200
川西倉庫	5,800	1,026.000	5,950,800
安田倉庫	6,600	1,034.000	6,824,400
上組	37,300	2,904.000	108,319,200
キムラユニティー	4,000	1,010.000	4,040,000
キューソー流通システム	7,100	984.000	6,986,400
エーアイティー	5,300	1,565.000	8,294,500
内外トランスライン	3,100	2,707.000	8,391,700
日本コンセプト	3,000	1,610.000	4,830,000
N E C ネットズエスアイ	26,400	1,612.000	42,556,800

クロスキャット	5,200	1,171.000	6,089,200
システナ	133,100	277.000	36,868,700
デジタルアーツ	5,100	4,970.000	25,347,000
日鉄ソリューションズ	13,300	3,560.000	47,348,000
キューブシステム	5,600	1,149.000	6,434,400
コア	3,700	1,574.000	5,823,800
手間いらず	1,400	4,800.000	6,720,000
ラクーンホールディングス	7,700	741.000	5,705,700
ソリトンシステムズ	4,800	1,021.000	4,900,800
ソフトクリエイティブホールディングス	7,000	1,637.000	11,459,000
T I S	86,200	3,645.000	314,199,000
グリー	22,400	689.000	15,433,600
コーエーテクモホールディングス	49,600	2,433.000	120,676,800
三菱総合研究所	3,900	4,955.000	19,324,500
ファインデックス	7,500	612.000	4,590,000
ブレインパッド	6,600	664.000	4,382,400
K L a b	18,700	381.000	7,124,700
ポルトゥウィンホールディングス	14,300	904.000	12,927,200
ネクソン	204,500	3,035.000	620,657,500
アイスタイル	24,000	519.000	12,456,000
エムアップホールディングス	10,200	1,169.000	11,923,800
エイチーム	7,200	678.000	4,881,600
エニグモ	11,700	427.000	4,995,900
コロプラ	30,800	629.000	19,373,200
ブロードリーフ	48,400	408.000	19,747,200
クロス・マーケティンググループ	5,400	694.000	3,747,600
デジタルハーツホールディングス	5,400	1,429.000	7,716,600
システム情報	7,800	783.000	6,107,400
メディアドゥ	3,700	1,400.000	5,180,000
じげん	24,400	488.000	11,907,200
ブイキューブ	11,300	514.000	5,808,200
フィックスターズ	9,500	1,398.000	13,281,000
C A R T A H O L D I N G S	4,300	1,422.000	6,114,600
オブティム	7,000	910.000	6,370,000
セレス	3,600	1,388.000	4,996,800
S H I F T	5,800	23,350.000	135,430,000
ティーガイア	8,900	1,642.000	14,613,800
テクマトリックス	14,800	1,576.000	23,324,800
プロシップ	4,100	1,360.000	5,576,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	24,500	2,557.000	62,646,500
G M O ペイメントゲートウェイ	18,100	10,380.000	187,878,000
システムリサーチ	2,800	2,402.000	6,725,600
インターネットイニシアティブ	44,100	2,755.000	121,495,500
さくらインターネット	10,300	606.000	6,241,800
ヴィンクス	3,400	1,327.000	4,511,800
G M O グローバルサイン・ホールディングス	2,500	3,740.000	9,350,000
S R A ホールディングス	4,300	2,988.000	12,848,400
朝日ネット	9,400	581.000	5,461,400

e B A S E	11,800	665.000	7,847,000
アバントグループ	10,200	1,378.000	14,055,600
アドソル日進	3,700	1,693.000	6,264,100
フリービット	4,700	1,457.000	6,847,900
コムチュア	10,700	1,953.000	20,897,100
アステリア	7,200	617.000	4,442,400
アイル	4,600	2,617.000	12,038,200
マークラインズ	4,700	2,345.000	11,021,500
メディカル・データ・ビジョン	12,600	810.000	10,206,000
g u m i	12,800	689.000	8,819,200
テラスカイ	4,000	2,629.000	10,516,000
デジタル・インフォメーション・テクノロ ジー	5,000	1,607.000	8,035,000
P R T I M E S	2,400	1,396.000	3,350,400
ラクス	37,500	2,013.000	75,487,500
ダブルスタンダード	3,600	2,011.000	7,239,600
オープンドア	6,000	1,451.000	8,706,000
アカツキ	4,100	2,203.000	9,032,300
U B I C O Mホールディングス	2,900	2,131.000	6,179,900
カナミックネットワーク	14,300	451.000	6,449,300
チェンジホールディングス	19,500	2,275.000	44,362,500
オークネット	4,600	1,521.000	6,996,600
マクロミル	16,300	898.000	14,637,400
オロ	2,700	2,388.000	6,447,600
ユーザーローカル	3,100	2,010.000	6,231,000
マネーフォワード	19,200	5,440.000	104,448,000
S U N A S T E R I S K	4,800	949.000	4,555,200
電算システムホールディングス	4,200	2,625.000	11,025,000
A P P I E R G R O U P	22,700	1,438.000	32,642,600
プロトコーポレーション	10,300	1,173.000	12,081,900
野村総合研究所	162,100	3,250.000	526,825,000
サイバネットシステム	8,800	850.000	7,480,000
日本システム技術	3,500	1,947.000	6,814,500
インテージホールディングス	9,300	1,544.000	14,359,200
ソースネクスト	34,100	221.000	7,536,100
インフォコム	10,200	2,348.000	23,949,600
シンプレクス・ホールディングス	13,600	2,249.000	30,586,400
H E R O Z	3,000	1,120.000	3,360,000
ラクスル	22,800	1,311.000	29,890,800
メルカリ	35,900	2,270.000	81,493,000
I P S	2,800	2,477.000	6,935,600
システムサポート	3,500	1,898.000	6,643,000
イーソル	5,900	887.000	5,233,300
アルテリア・ネットワークス	8,200	1,285.000	10,537,000
ウイングアーク1 s t	8,500	2,081.000	17,688,500
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディ ングス	2,600	1,558.000	4,050,800
サーバーワークス	1,900	1,849.000	3,513,100

Sansan	26,200	1,756.000	46,007,200
ギフトィ	8,800	2,064.000	18,163,200
メドレー	8,000	3,480.000	27,840,000
ベース	2,700	5,770.000	15,579,000
JMDC	13,100	4,670.000	61,177,000
フォーカスシステムズ	6,800	1,002.000	6,813,600
クレスコ	6,300	1,742.000	10,974,600
フジ・メディア・ホールディングス	76,300	1,240.000	94,612,000
オービック	26,300	21,130.000	555,719,000
ジャストシステム	11,400	3,490.000	39,786,000
TDCソフト	7,100	1,426.000	10,124,600
Zホールディングス	1,125,700	368.600	414,933,020
トレンドマイクロ	45,700	6,540.000	298,878,000
IDホールディングス	3,500	998.000	3,493,000
日本オラクル	15,300	9,500.000	145,350,000
アルファシステムズ	2,600	4,040.000	10,504,000
フューチャー	19,700	1,815.000	35,755,500
CAC HOLDINGS	5,300	1,689.000	8,951,700
S Bテクノロジー	3,700	2,142.000	7,925,400
オービックビジネスコンサルタント	15,600	5,140.000	80,184,000
伊藤忠テクノソリューションズ	42,300	3,270.000	138,321,000
アイティフォー	10,900	863.000	9,406,700
東計電算	1,400	6,430.000	9,002,000
大塚商会	44,800	4,865.000	217,952,000
サイボウズ	11,100	2,575.000	28,582,500
電通国際情報サービス	9,600	4,960.000	47,616,000
ACCESS	10,400	834.000	8,673,600
デジタルガレージ	14,200	4,550.000	64,610,000
イーエムシステムズ	14,100	785.000	11,068,500
ウェザーニューズ	2,500	6,720.000	16,800,000
CIJ	14,400	543.000	7,819,200
ビジネスエンジニアリング	1,800	3,260.000	5,868,000
WOWOW	5,700	1,253.000	7,142,100
スカラ	8,700	748.000	6,507,600
IMAGICA GROUP	8,000	601.000	4,808,000
ネットワンシステムズ	29,600	3,125.000	92,500,000
アルゴグラフィックス	7,300	3,765.000	27,484,500
マーベラス	14,000	666.000	9,324,000
エイベックス	14,100	1,527.000	21,530,700
BIPROGY	29,200	3,225.000	94,170,000
都築電気	4,700	1,501.000	7,054,700
TBSホールディングス	40,600	2,012.000	81,687,200
日本テレビホールディングス	70,200	1,192.000	83,678,400
朝日放送グループホールディングス	10,000	664.000	6,640,000
テレビ朝日ホールディングス	19,100	1,537.000	29,356,700
スカパーJ S A Tホールディングス	71,300	531.000	37,860,300
テレビ東京ホールディングス	6,000	2,512.000	15,072,000
日本BS放送	3,700	889.000	3,289,300

ビジョン	10,700	1,637.000	17,515,900
USEN-NEXT HOLDINGS	7,200	3,010.000	21,672,000
日本通信	76,300	252.000	19,227,600
日本電信電話	1,011,800	4,084.000	4,132,191,200
KDDI	610,300	4,164.000	2,541,289,200
ソフトバンク	1,268,700	1,529.000	1,939,842,300
光通信	9,300	18,190.000	169,167,000
エムティーアイ	9,300	513.000	4,770,900
GMOインターネットグループ	29,400	2,631.000	77,351,400
ファイバーゲート	5,100	1,171.000	5,972,100
KADOKAWA	41,800	2,844.000	118,879,200
学研ホールディングス	14,400	864.000	12,441,600
ゼンリン	13,800	867.000	11,964,600
アイネット	5,700	1,293.000	7,370,100
松竹	4,600	11,830.000	54,418,000
東宝	49,300	5,240.000	258,332,000
東映	2,200	18,030.000	39,666,000
エヌ・ティ・ティ・データ	247,200	1,823.000	450,645,600
ピー・シー・エー	5,200	1,185.000	6,162,000
ビジネスブレイン太田昭和	3,900	1,938.000	7,558,200
DT S	16,500	3,185.000	52,552,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	39,700	6,570.000	260,829,000
シーイーシー	11,500	1,368.000	15,732,000
カプコン	78,500	5,000.000	392,500,000
アイ・エス・ビー	4,500	1,168.000	5,256,000
ジャステック	5,500	1,216.000	6,688,000
SCSK	64,100	1,967.000	126,084,700
NSW	3,200	2,053.000	6,569,600
アイネス	6,300	1,329.000	8,372,700
TKC	13,800	3,620.000	49,956,000
富士ソフト	8,900	7,950.000	70,755,000
NSD	27,800	2,448.000	68,054,400
コナミグループ	33,800	6,520.000	220,376,000
福井コンピュータホールディングス	5,600	2,640.000	14,784,000
JBC Cホールディングス	6,000	2,108.000	12,648,000
ミロク情報サービス	7,700	1,641.000	12,635,700
ソフトバンクグループ	456,600	5,040.000	2,301,264,000
高千穂交易	3,000	2,301.000	6,903,000
伊藤忠食品	2,100	5,340.000	11,214,000
エレマテック	7,800	1,749.000	13,642,200
あらた	6,500	4,270.000	27,755,000
トーマンデバイス	1,300	6,360.000	8,268,000
東京エレクトロン デバイス	3,100	8,210.000	25,451,000
円谷フィールズホールディングス	14,600	1,778.000	25,958,800
双日	88,300	2,840.000	250,772,000
アルフレッサ ホールディングス	84,200	1,934.000	162,842,800
横浜冷凍	24,800	1,071.000	26,560,800
ラサ商事	4,800	1,400.000	6,720,000

アルコニックス	11,900	1,361.000	16,195,900
神戸物産	64,600	3,780.000	244,188,000
あい ホールディングス	13,200	2,295.000	30,294,000
ダイワボウホールディングス	34,200	2,478.000	84,747,600
マクニカホールディングス	20,300	3,685.000	74,805,500
ラクト・ジャパン	3,800	2,055.000	7,809,000
グリムス	3,700	2,091.000	7,736,700
バイタルケーエスケー・ホールディングス	13,900	959.000	13,330,100
八洲電機	7,900	1,280.000	10,112,000
メディアスホールディングス	7,000	827.000	5,789,000
レスターホールディングス	8,000	2,107.000	16,856,000
ジューテックホールディングス	2,500	1,168.000	2,920,000
大光	9,500	621.000	5,899,500
TOKAIホールディングス	42,300	876.000	37,054,800
三洋貿易	9,100	1,267.000	11,529,700
ビューティガレージ	1,500	3,720.000	5,580,000
ウイン・パートナーズ	6,700	1,006.000	6,740,200
ミタチ産業	3,200	1,386.000	4,435,200
シップヘルスケアホールディングス	30,300	2,393.000	72,507,900
コメダホールディングス	21,200	2,543.000	53,911,600
フルサト・マルカホールディングス	8,400	2,522.000	21,184,800
ヤマエグループホールディングス	5,300	2,115.000	11,209,500
小野建	8,400	1,522.000	12,784,800
南陽	2,400	2,268.000	5,443,200
佐島電機	5,400	1,568.000	8,467,200
伯東	4,800	4,310.000	20,688,000
コンドーテック	7,600	1,015.000	7,714,000
ナガイレーベン	11,000	2,046.000	22,506,000
三菱食品	8,500	3,400.000	28,900,000
松田産業	6,500	2,213.000	14,384,500
第一興商	32,600	2,369.000	77,229,400
メディバルホールディングス	80,100	2,058.000	164,845,800
S P K	4,500	1,710.000	7,695,000
萩原電気ホールディングス	3,500	3,170.000	11,095,000
アズワン	12,000	5,610.000	67,320,000
スズデン	3,900	2,485.000	9,691,500
尾家産業	4,700	1,152.000	5,414,400
シモジマ	7,000	1,124.000	7,868,000
ドウシシャ	8,900	2,098.000	18,672,200
高速	4,600	2,121.000	9,756,600
たけびし	2,500	1,670.000	4,175,000
リックス	2,200	2,660.000	5,852,000
丸文	8,200	1,193.000	9,782,600
ハピネット	7,900	1,902.000	15,025,800
日本ライフライン	25,100	915.000	22,966,500
タカショー	9,100	684.000	6,224,400
I D O M	26,200	806.000	21,117,200
進和	6,100	2,095.000	12,779,500

ダイトロン	3,500	2,583.000	9,040,500
シークス	12,000	1,320.000	15,840,000
オーハシテクニカ	5,000	1,576.000	7,880,000
白銅	3,300	2,633.000	8,688,900
伊藤忠商事	513,000	4,424.000	2,269,512,000
丸紅	649,800	1,899.000	1,233,970,200
長瀬産業	37,900	2,067.000	78,339,300
蝶理	4,600	2,502.000	11,509,200
豊田通商	72,600	5,730.000	415,998,000
三共生興	15,900	572.000	9,094,800
兼松	31,900	1,753.000	55,920,700
三井物産	609,400	4,173.000	2,543,026,200
日本紙パルプ商事	4,500	5,070.000	22,815,000
カメイ	9,300	1,514.000	14,080,200
スターゼン	6,600	2,300.000	15,180,000
山善	22,300	1,031.000	22,991,300
椿本興業	1,600	4,065.000	6,504,000
住友商事	515,800	2,413.000	1,244,625,400
内田洋行	3,800	5,040.000	19,152,000
三菱商事	520,800	4,974.000	2,590,459,200
第一実業	3,100	5,670.000	17,577,000
キャノンマーケティングジャパン	19,500	3,280.000	63,960,000
西華産業	3,900	2,170.000	8,463,000
佐藤商事	6,300	1,388.000	8,744,400
菱洋エレクトロ	7,500	2,476.000	18,570,000
東京産業	9,300	828.000	7,700,400
ユアサ商事	7,500	3,880.000	29,100,000
神鋼商事	2,200	5,760.000	12,672,000
阪和興業	14,900	4,070.000	60,643,000
正栄食品工業	5,800	4,150.000	24,070,000
カナデン	7,700	1,196.000	9,209,200
RYODEN	7,100	2,054.000	14,583,400
岩谷産業	19,100	6,390.000	122,049,000
ナイス	3,300	1,309.000	4,319,700
極東貿易	6,000	1,495.000	8,970,000
アステナホールディングス	17,700	448.000	7,929,600
三愛オブリ	22,200	1,371.000	30,436,200
稲畑産業	16,600	2,731.000	45,334,600
G S Iクレオス	5,600	1,817.000	10,175,200
明和産業	12,500	698.000	8,725,000
ワキタ	16,300	1,353.000	22,053,900
東邦ホールディングス	21,500	2,676.000	57,534,000
サンゲツ	21,500	2,233.000	48,009,500
ミツウロコグループホールディングス	11,900	1,304.000	15,517,600
シナネンホールディングス	3,100	3,575.000	11,082,500
伊藤忠エネクス	20,700	1,116.000	23,101,200
サンリオ	23,700	6,310.000	149,547,000
サンワ テクノス	4,700	1,841.000	8,652,700

リョーサン	9,200	3,125.000	28,750,000
新光商事	12,100	1,181.000	14,290,100
トーホー	4,000	2,299.000	9,196,000
三信電気	3,900	2,251.000	8,778,900
東陽テクニカ	9,800	1,400.000	13,720,000
モスフードサービス	12,500	3,090.000	38,625,000
加賀電子	6,700	4,745.000	31,791,500
ソーダニッカ	7,300	807.000	5,891,100
立花エレテック	6,300	2,020.000	12,726,000
PALTAC	13,300	5,240.000	69,692,000
三谷産業	20,100	318.000	6,391,800
太平洋興発	6,200	846.000	5,245,200
西本Wismettacホールディングス	2,400	3,795.000	9,108,000
KPPグループホールディングス	20,600	643.000	13,245,800
ヤマタネ	5,000	1,689.000	8,445,000
泉州電業	4,300	3,220.000	13,846,000
トラスコ中山	17,700	2,244.000	39,718,800
オートバックスセブン	29,600	1,520.000	44,992,000
モリト	7,300	1,047.000	7,643,100
加藤産業	10,100	3,545.000	35,804,500
イエローハット	14,900	1,906.000	28,399,400
JKホールディングス	7,200	1,038.000	7,473,600
日伝	5,300	1,965.000	10,414,500
杉本商事	4,000	2,017.000	8,068,000
因幡電機産業	21,200	2,977.000	63,112,400
東テク	3,000	4,225.000	12,675,000
ミスミグループ本社	125,700	3,205.000	402,868,500
タキヒヨー	4,400	979.000	4,307,600
スズケン	26,300	3,830.000	100,729,000
ジェコス	6,500	922.000	5,993,000
グローセル	14,200	406.000	5,765,200
ローソン	20,800	6,090.000	126,672,000
サンエー	6,400	4,525.000	28,960,000
カワチ薬品	6,700	2,331.000	15,617,700
エービーシー・マート	12,200	7,770.000	94,794,000
ハードオフコーポレーション	4,000	1,362.000	5,448,000
アスクル	17,600	1,778.000	31,292,800
ゲオホールディングス	8,900	1,612.000	14,346,800
アダストリア	10,300	2,576.000	26,532,800
くら寿司	9,900	3,320.000	32,868,000
キャンドゥ	4,200	2,409.000	10,117,800
パルグループホールディングス	8,400	3,250.000	27,300,000
エディオン	32,600	1,321.000	43,064,600
サーラコーポレーション	18,900	752.000	14,212,800
ハローズ	3,900	3,190.000	12,441,000
あみやき亭	1,500	3,670.000	5,505,000
大黒天物産	2,800	5,500.000	15,400,000
ハニーズホールディングス	7,000	1,550.000	10,850,000

アルペン	7,100	2,056.000	14,597,600
クオールホールディングス	12,100	1,227.000	14,846,700
ジンスホールディングス	5,200	2,986.000	15,527,200
ビックカメラ	55,800	1,137.000	63,444,600
D C Mホールディングス	51,600	1,416.000	73,065,600
Monotaro	118,100	1,901.000	224,508,100
アークランドサービスホールディングス	6,700	2,750.000	18,425,000
J . フロント リテイリング	104,100	1,430.000	148,863,000
ドトール・日レスホールディングス	14,900	2,131.000	31,751,900
マツキヨココカラ&カンパニー	50,600	7,310.000	369,886,000
ブロンコビリー	4,500	2,674.000	12,033,000
Z O Z O	55,200	2,940.000	162,288,000
トレジャー・ファクトリー	5,100	1,754.000	8,945,400
物語コーポレーション	14,100	2,781.000	39,212,100
三越伊勢丹ホールディングス	140,500	1,498.000	210,469,000
ウエルシアホールディングス	43,400	2,794.000	121,259,600
クリエイトSDホールディングス	13,600	3,300.000	44,880,000
チムニー	6,300	1,320.000	8,316,000
シュッピン	7,200	870.000	6,264,000
オイシックス・ラ・大地	11,400	2,510.000	28,614,000
ネクステージ	19,200	2,410.000	46,272,000
ジョイフル本田	24,800	1,790.000	44,392,000
鳥貴族ホールディングス	3,700	2,217.000	8,202,900
ホットランド	7,100	1,534.000	10,891,400
すかいらくホールディングス	113,900	1,814.000	206,614,600
S F Pホールディングス	5,000	1,993.000	9,965,000
綿半ホールディングス	7,000	1,412.000	9,884,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	29,300	1,165.000	34,134,500
B E E N O S	5,000	1,883.000	9,415,000
あさひ	7,100	1,289.000	9,151,900
日本調剤	6,400	1,197.000	7,660,800
コスモス薬品	8,300	13,110.000	108,813,000
セブン&アイ・ホールディングス	287,200	5,984.000	1,718,604,800
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	63,100	983.000	62,027,300
ツルハホールディングス	17,600	8,680.000	152,768,000
サンマルクホールディングス	7,100	1,845.000	13,099,500
フェリシモ	4,600	995.000	4,577,000
トリドールホールディングス	20,800	2,863.000	59,550,400
T O K Y O B A S E	9,500	426.000	4,047,000
J Mホールディングス	7,400	1,971.000	14,585,400
アレンザホールディングス	7,300	983.000	7,175,900
串カツ田中ホールディングス	3,500	1,687.000	5,904,500
クスリのアオキホールディングス	7,600	6,350.000	48,260,000
力の源ホールディングス	4,900	1,439.000	7,051,100
FOOD & LIFE COMPANIES	48,000	3,165.000	151,920,000

ノジマ	27,300	1,430.000	39,039,000
カップ・クリエイト	13,700	1,492.000	20,440,400
ライトオン	1,000	569.000	569,000
良品計画	107,700	1,378.000	148,410,600
アドヴァングループ	10,200	923.000	9,414,600
アルピス	3,200	2,541.000	8,131,200
G - 7ホールディングス	10,600	1,400.000	14,840,000
イオン北海道	14,500	806.000	11,687,000
コジマ	17,400	567.000	9,865,800
コーナン商事	11,400	3,650.000	41,610,000
エコス	3,700	1,875.000	6,937,500
ワタミ	11,000	920.000	10,120,000
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	168,300	2,507.000	421,928,100
西松屋チェーン	18,800	1,604.000	30,155,200
ゼンショーホールディングス	45,600	4,290.000	195,624,000
幸楽苑ホールディングス	6,500	1,049.000	6,818,500
サイゼリヤ	14,100	3,410.000	48,081,000
V Tホールディングス	31,300	529.000	16,557,700
フジ・コーポレーション	5,000	1,285.000	6,425,000
ユナイテッドアローズ	9,200	1,987.000	18,280,400
ハイデイ日高	12,300	2,266.000	27,871,800
コロワイド	38,700	2,072.000	80,186,400
壱番屋	6,500	5,370.000	34,905,000
スギホールディングス	16,900	5,810.000	98,189,000
薬王堂ホールディングス	5,100	2,448.000	12,484,800
スクロール	12,900	779.000	10,049,100
ヨンドシーホールディングス	7,600	1,768.000	13,436,800
木曽路	12,800	2,312.000	29,593,600
S R Sホールディングス	15,700	995.000	15,621,500
千趣会	18,000	405.000	7,290,000
リテールパートナーズ	12,500	1,488.000	18,600,000
ケーヨー	14,900	823.000	12,262,700
上新電機	7,100	1,977.000	14,036,700
日本瓦斯	45,200	1,783.000	80,591,600
ロイヤルホールディングス	16,300	2,826.000	46,063,800
いなげや	8,600	1,607.000	13,820,200
チヨダ	10,600	826.000	8,755,600
ライフコーポレーション	7,500	2,868.000	21,510,000
リンガーハット	11,100	2,388.000	26,506,800
Mr Max HD	13,000	615.000	7,995,000
A O K Iホールディングス	16,200	937.000	15,179,400
オークワ	14,700	876.000	12,877,200
コメリ	12,900	3,150.000	40,635,000
青山商事	19,000	900.000	17,100,000
しまむら	9,800	12,410.000	121,618,000
高島屋	63,300	2,054.000	130,018,200
松屋	14,800	1,181.000	17,478,800

エイチ・ツー・オー リテイリング	40,900	1,610.000	65,849,000
近鉄百貨店	4,000	2,426.000	9,704,000
丸井グループ	61,400	2,123.000	130,352,200
アクシアル リテイリング	5,700	3,470.000	19,779,000
イオン	282,400	2,744.000	774,905,600
イズミ	12,800	3,145.000	40,256,000
平和堂	13,800	2,028.000	27,986,400
フジ	13,000	1,748.000	22,724,000
ヤオコー	9,400	7,110.000	66,834,000
ゼビオホールディングス	11,500	1,166.000	13,409,000
ケーズホールディングス	66,400	1,189.000	78,949,600
OLYMPICグループ	2,400	525.000	1,260,000
シルバーライフ	2,500	1,244.000	3,110,000
Genky DrugStores	3,800	3,980.000	15,124,000
ブックオフグループホールディングス	5,700	1,338.000	7,626,600
ギフトホールディングス	1,900	4,560.000	8,664,000
アインホールディングス	11,600	5,520.000	64,032,000
元気寿司	3,200	3,260.000	10,432,000
ヤマダホールディングス	341,800	466.000	159,278,800
アーケランズ	12,900	1,488.000	19,195,200
ニトリホールディングス	33,700	17,165.000	578,460,500
グルメ杵屋	8,300	1,046.000	8,681,800
ケーユーホールディングス	5,800	1,367.000	7,928,600
吉野家ホールディングス	32,700	2,494.000	81,553,800
松屋フーズホールディングス	3,900	4,220.000	16,458,000
サガミホールディングス	13,900	1,318.000	18,320,200
関西フードマーケット	8,700	1,492.000	12,980,400
王将フードサービス	5,300	6,140.000	32,542,000
ミニストップ	6,700	1,404.000	9,406,800
アークス	15,000	2,437.000	36,555,000
パローホールディングス	15,700	2,036.000	31,965,200
ベルク	4,100	6,040.000	24,764,000
大 庄	7,100	1,108.000	7,866,800
ファーストリテイリング	37,500	31,720.000	1,189,500,000
サンドラッグ	31,700	3,720.000	117,924,000
サックスパー ホールディングス	9,300	868.000	8,072,400
やまや	3,100	2,654.000	8,227,400
ベルーナ	20,700	734.000	15,193,800
いよぎんホールディングス	92,900	771.000	71,625,900
しずおかフィナンシャルグループ	175,100	991.000	173,524,100
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	65,000	895.000	58,175,000
じもとホールディングス	2,100	400.000	840,000
めぶきフィナンシャルグループ	383,700	335.000	128,539,500
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10,100	2,673.000	26,997,300
九州フィナンシャルグループ	134,600	478.000	64,338,800
ゆうちょ銀行	221,300	1,085.000	240,110,500
富山第一銀行	21,100	599.000	12,638,900
コンコルディア・フィナンシャルグループ	427,000	502.000	214,354,000

西日本フィナンシャルホールディングス	48,900	1,086.000	53,105,400
三十三フィナンシャルグループ	7,500	1,563.000	11,722,500
第四北越フィナンシャルグループ	11,800	2,955.000	34,869,000
ひろぎんホールディングス	99,900	657.000	65,634,300
おきなわフィナンシャルグループ	7,800	2,070.000	16,146,000
十六フィナンシャルグループ	9,900	2,929.000	28,997,100
北國フィナンシャルホールディングス	6,800	4,385.000	29,818,000
プロクレアホールディングス	9,900	2,133.000	21,116,700
あいちフィナンシャルグループ	11,000	2,066.000	22,726,000
S B I 新生銀行	23,600	2,411.000	56,899,600
あおぞら銀行	48,300	2,416.000	116,692,800
三菱U F J フィナンシャル・グループ	4,854,300	843.200	4,093,145,760
りそなホールディングス	979,100	650.400	636,806,640
三井住友トラスト・ホールディングス	140,500	4,842.000	680,301,000
三井住友フィナンシャルグループ	566,200	5,513.000	3,121,460,600
千葉銀行	215,200	860.000	185,072,000
群馬銀行	149,100	454.000	67,691,400
武蔵野銀行	9,600	2,158.000	20,716,800
千葉興業銀行	17,800	529.000	9,416,200
筑波銀行	38,800	208.000	8,070,400
七十七銀行	24,800	2,126.000	52,724,800
秋田銀行	5,800	1,750.000	10,150,000
山形銀行	9,900	1,061.000	10,503,900
岩手銀行	5,700	2,128.000	12,129,600
東邦銀行	65,800	222.000	14,607,600
東北銀行	7,200	968.000	6,969,600
ふくおかフィナンシャルグループ	61,700	2,498.000	154,126,600
スルガ銀行	69,500	508.000	35,306,000
八十二銀行	132,600	590.000	78,234,000
山梨中央銀行	9,100	1,107.000	10,073,700
大垣共立銀行	14,400	1,809.000	26,049,600
福井銀行	7,500	1,458.000	10,935,000
清水銀行	1,600	1,453.000	2,324,800
滋賀銀行	13,000	2,757.000	35,841,000
南都銀行	11,600	2,398.000	27,816,800
百五銀行	72,600	384.000	27,878,400
京都銀行	24,400	6,380.000	155,672,000
紀陽銀行	27,300	1,539.000	42,014,700
ほくほくフィナンシャルグループ	48,800	957.000	46,701,600
山陰合同銀行	48,000	749.000	35,952,000
鳥取銀行	5,500	1,176.000	6,468,000
百十四銀行	7,500	1,825.000	13,687,500
四国銀行	13,400	869.000	11,644,600
阿波銀行	11,400	1,978.000	22,549,200
大分銀行	5,200	2,030.000	10,556,000
宮崎銀行	5,200	2,391.000	12,433,200
佐賀銀行	5,000	1,640.000	8,200,000
琉球銀行	18,600	912.000	16,963,200

セブン銀行	278,500	275.000	76,587,500
みずほフィナンシャルグループ	1,120,400	1,961.500	2,197,664,600
山口フィナンシャルグループ	85,300	818.000	69,775,400
長野銀行	10,700	1,489.000	15,932,300
名古屋銀行	5,100	3,340.000	17,034,000
北洋銀行	117,400	283.000	33,224,200
愛媛銀行	11,700	844.000	9,874,800
京葉銀行	36,800	558.000	20,534,400
栃木銀行	39,200	275.000	10,780,000
北日本銀行	3,300	2,017.000	6,656,100
東和銀行	15,900	551.000	8,760,900
トモニホールディングス	63,500	357.000	22,669,500
フィデアホールディングス	8,600	1,340.000	11,524,000
池田泉州ホールディングス	102,400	237.000	24,268,800
F P G	31,900	1,144.000	36,493,600
ジャパンインベストメントアドバイザー	6,800	1,116.000	7,588,800
マーキュリアホールディングス	5,700	698.000	3,978,600
S B Iホールディングス	111,600	2,630.000	293,508,000
ジャフコ グループ	26,300	1,727.000	45,420,100
大和証券グループ本社	550,600	623.000	343,023,800
野村ホールディングス	1,425,000	523.300	745,702,500
岡三証券グループ	67,800	464.000	31,459,200
丸三証券	28,500	421.000	11,998,500
東洋証券	28,500	323.000	9,205,500
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	81,400	373.000	30,362,200
水戸証券	23,800	297.000	7,068,600
いちよし証券	15,600	591.000	9,219,600
松井証券	45,900	776.000	35,618,400
マネックスグループ	86,800	482.000	41,837,600
極東証券	12,700	600.000	7,620,000
岩井コスモホールディングス	9,300	1,315.000	12,229,500
アイザワ証券グループ	12,700	700.000	8,890,000
スパークス・グループ	8,900	1,415.000	12,593,500
かんぽ生命保険	94,200	2,172.000	204,602,400
S O M P Oホールディングス	133,000	5,509.000	732,697,000
アニコム ホールディングス	29,100	518.000	15,073,800
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	157,300	4,334.000	681,738,200
第一生命ホールディングス	394,800	2,443.500	964,693,800
東京海上ホールディングス	780,400	2,669.000	2,082,887,600
T & Dホールディングス	208,300	1,666.000	347,027,800
アドバンスクリエイト	6,500	1,104.000	7,176,000
全国保証	20,400	4,910.000	100,164,000
ジェイリース	2,700	1,970.000	5,319,000
日本モーゲージサービス	7,800	665.000	5,187,000
アルヒ	11,000	1,088.000	11,968,000
プレミアグループ	13,500	1,558.000	21,033,000
ネットプロテクションズホールディングス	26,700	492.000	13,136,400

クレディセゾン	49,500	1,832.000	90,684,000
芙蓉総合リース	7,100	9,690.000	68,799,000
みずほリース	11,200	3,710.000	41,552,000
東京センチュリー	14,300	4,495.000	64,278,500
日本証券金融	32,000	993.000	31,776,000
アイフル	130,400	363.000	47,335,200
リコーリース	7,400	3,850.000	28,490,000
イオンフィナンシャルサービス	44,400	1,192.000	52,924,800
アコム	146,500	324.000	47,466,000
ジャックス	8,300	4,460.000	37,018,000
オリエントコーポレーション	20,400	1,113.000	22,705,200
オリックス	508,100	2,261.500	1,149,068,150
三菱HCキャピタル	298,800	695.000	207,666,000
九州リースサービス	6,100	862.000	5,258,200
日本取引所グループ	217,800	2,130.500	464,022,900
イー・ギャランティ	13,300	2,117.000	28,156,100
NECキャピタルソリューション	4,100	2,611.000	10,705,100
大東建託	28,400	13,810.000	392,204,000
いちご	105,000	255.000	26,775,000
日本駐車場開発	98,300	230.000	22,609,000
スター・マイカ・ホールディングス	8,900	639.000	5,687,100
SREホールディングス	4,000	3,020.000	12,080,000
ヒューリック	180,500	1,149.000	207,394,500
三栄建築設計	4,800	1,446.000	6,940,800
野村不動産ホールディングス	48,300	3,245.000	156,733,500
三重交通グループホールディングス	19,100	578.000	11,039,800
サムティ	10,100	2,171.000	21,927,100
ディア・ライフ	14,100	693.000	9,771,300
地主	7,000	1,921.000	13,447,000
プレサンスコーポレーション	10,900	1,882.000	20,513,800
JPMC	5,600	1,101.000	6,165,600
フージャースホールディングス	13,400	831.000	11,135,400
オープンハウスグループ	28,400	5,150.000	146,260,000
東急不動産ホールディングス	233,100	657.000	153,146,700
飯田グループホールディングス	67,600	2,305.000	155,818,000
シーアールイー	4,500	1,268.000	5,706,000
ケイアイスター不動産	5,000	4,005.000	20,025,000
グッドコムアセット	8,500	766.000	6,511,000
ジェイ・エス・ビー	2,200	4,280.000	9,416,000
ロードスターキャピタル	4,000	1,388.000	5,552,000
パーク24	60,800	2,072.000	125,977,600
パラカ	3,900	1,919.000	7,484,100
宮越ホールディングス	4,600	794.000	3,652,400
三井不動産	335,300	2,591.000	868,762,300
三菱地所	468,400	1,623.000	760,213,200
平和不動産	14,000	3,835.000	53,690,000
東京建物	73,900	1,664.000	122,969,600
京阪神ビルディング	10,900	1,222.000	13,319,800

住友不動産	140,300	3,060.000	429,318,000
テーオーシー	17,700	652.000	11,540,400
東京楽天地	1,800	4,255.000	7,659,000
スターツコーポレーション	13,000	2,489.000	32,357,000
フジ住宅	12,700	703.000	8,928,100
空港施設	12,000	563.000	6,756,000
ゴールドクレスト	8,200	1,781.000	14,604,200
エスリード	4,100	2,182.000	8,946,200
日神グループホールディングス	15,200	457.000	6,946,400
日本エスコン	24,000	857.000	20,568,000
M I R A R T Hホールディングス	42,800	377.000	16,135,600
イオンモール	40,600	1,855.000	75,313,000
毎日コムネット	4,000	822.000	3,288,000
カチタス	23,000	2,563.000	58,949,000
トーセイ	16,000	1,536.000	24,576,000
穴吹興産	2,900	2,287.000	6,632,300
サンフロンティア不動産	16,000	1,293.000	20,688,000
F Jネクストホールディングス	9,000	1,019.000	9,171,000
日本空港ビルデング	27,600	6,700.000	184,920,000
日本工営	5,100	3,610.000	18,411,000
L I F U L L	32,400	213.000	6,901,200
M I X I	18,800	2,820.000	53,016,000
ジェイエイシーリクルートメント	7,300	2,509.000	18,315,700
日本M & Aセンターホールディングス	139,500	1,006.000	140,337,000
メンバーズ	3,100	1,220.000	3,782,000
U Tグループ	12,000	2,494.000	29,928,000
アイティメディア	3,500	1,369.000	4,791,500
E・Jホールディングス	5,400	1,574.000	8,499,600
オープンアップグループ	24,300	1,945.000	47,263,500
コシダカホールディングス	25,200	1,178.000	29,685,600
パソナグループ	10,000	1,805.000	18,050,000
リンクアンドモチベーション	24,600	472.000	11,611,200
エス・エム・エス	30,900	3,115.000	96,253,500
パーソルホールディングス	90,400	2,713.000	245,255,200
リニカル	6,300	684.000	4,309,200
クックパッド	33,500	188.000	6,298,000
学情	4,100	1,632.000	6,691,200
スタジオアリス	4,800	2,125.000	10,200,000
シミックホールディングス	5,100	1,951.000	9,950,100
総合警備保障	30,200	3,750.000	113,250,000
カカクコム	59,700	1,812.000	108,176,400
アイロムグループ	3,500	1,801.000	6,303,500
セントケア・ホールディング	1,800	761.000	1,369,800
ルネサンス	6,600	935.000	6,171,000
ディップ	14,300	3,310.000	47,333,000
デジタルホールディングス	7,300	1,154.000	8,424,200
新日本科学	8,800	2,451.000	21,568,800
キャリアデザインセンター	2,000	1,996.000	3,992,000

ベネフィット・ワン	37,700	1,780.000	67,106,000
エムスリー	160,100	3,255.000	521,125,500
アウトソーシング	48,500	1,339.000	64,941,500
ウェルネット	8,400	651.000	5,468,400
ワールドホールディングス	3,800	2,673.000	10,157,400
ディー・エヌ・エー	34,900	1,865.000	65,088,500
博報堂D Yホールディングス	103,100	1,573.000	162,176,300
タカミヤ	14,000	424.000	5,936,000
ジャパンベストレスキューシステム	6,400	755.000	4,832,000
ファンコミュニケーションズ	20,300	404.000	8,201,200
ライク	3,700	1,886.000	6,978,200
エスプール	24,600	608.000	14,956,800
WDBホールディングス	4,500	1,999.000	8,995,500
アドウェイズ	12,000	685.000	8,220,000
パリュコマース	6,400	1,726.000	11,046,400
インフォマート	85,600	286.000	24,481,600
J Pホールディングス	27,100	310.000	8,401,000
プレステージ・インターナショナル	35,400	581.000	20,567,400
アミューズ	5,000	1,825.000	9,125,000
ドリームインキュベータ	2,800	2,566.000	7,184,800
クイック	6,500	1,738.000	11,297,000
電通グループ	79,500	4,835.000	384,382,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	2,700	1,360.000	3,672,000
ぴあ	3,000	3,245.000	9,735,000
イオンファンタジー	3,900	3,215.000	12,538,500
シーティーエス	10,600	774.000	8,204,400
H . U . グループホールディングス	24,100	2,706.000	65,214,600
アルプス技研	7,200	2,521.000	18,151,200
日本空調サービス	10,700	734.000	7,853,800
オリエンタルランド	428,500	4,752.000	2,036,232,000
ダスキン	18,200	3,240.000	58,968,000
明光ネットワークジャパン	13,800	656.000	9,052,800
ファルコホールディングス	4,400	1,976.000	8,694,400
ラウンドワン	69,000	577.000	39,813,000
リゾートトラスト	32,300	2,223.000	71,802,900
ビー・エム・エル	10,100	2,998.000	30,279,800
リソー教育	41,100	302.000	12,412,200
早稲田アカデミー	5,900	1,372.000	8,094,800
ユー・エス・エス	83,300	2,243.000	186,841,900
東京個別指導学院	12,400	541.000	6,708,400
サイバーエージェント	194,200	1,178.000	228,767,600
楽天グループ	355,000	670.000	237,850,000
クリーク・アンド・リバー社	5,100	2,094.000	10,679,400
SBIグローバルアセットマネジメント	15,800	497.000	7,852,600
テー・オー・ダブリュー	19,300	327.000	6,311,100
山田コンサルティンググループ	4,800	1,503.000	7,214,400
セントラルスポーツ	3,700	2,513.000	9,298,100
フルキャストホールディングス	8,100	2,412.000	19,537,200

エン・ジャパン	14,900	2,322.000	34,597,800
テクノプロ・ホールディングス	47,900	3,675.000	176,032,500
アイ・アールジャパンホールディングス	4,500	2,107.000	9,481,500
Keepers 技研	5,100	4,925.000	25,117,500
Gunosy	8,100	590.000	4,779,000
イー・ガーディアン	3,500	2,179.000	7,626,500
ジャパンマテリアル	24,900	2,042.000	50,845,800
ベクトル	13,100	1,270.000	16,637,000
チャーム・ケア・コーポレーション	7,400	1,072.000	7,932,800
キャリアリンク	3,200	2,180.000	6,976,000
IBJ	6,000	641.000	3,846,000
アサンテ	5,200	1,656.000	8,611,200
バリューHR	7,900	1,509.000	11,921,100
M&Aキャピタルパートナーズ	7,600	3,615.000	27,474,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,200	1,072.000	4,502,400
ERIホールディングス	2,800	1,385.000	3,878,000
シグマクス・ホールディングス	13,000	1,031.000	13,403,000
ウィルグループ	7,000	1,042.000	7,294,000
メドピア	6,900	1,100.000	7,590,000
リクルートホールディングス	599,100	3,729.000	2,234,043,900
エラン	10,800	987.000	10,659,600
日本郵政	1,062,000	1,106.000	1,174,572,000
ベルシステム24ホールディングス	11,500	1,377.000	15,835,500
鎌倉新書	10,100	910.000	9,191,000
エアトリ	5,500	2,751.000	15,130,500
アトラエ	7,000	810.000	5,670,000
ストライク	4,100	3,490.000	14,309,000
ソラスト	23,200	620.000	14,384,000
セラク	3,300	1,570.000	5,181,000
インソース	20,400	1,192.000	24,316,800
ベイカレント・コンサルティング	64,200	4,725.000	303,345,000
アイモバイル	5,000	1,278.000	6,390,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	29,000	1,981.000	57,449,000
ウェルビー	7,700	617.000	4,750,900
エル・ティー・エス	1,300	2,512.000	3,265,600
ミダックホールディングス	5,100	1,901.000	9,695,100
日総工産	6,800	764.000	5,195,200
キュービーネットホールディングス	4,700	1,349.000	6,340,300
RPAホールディングス	12,900	372.000	4,798,800
マネジメントソリューションズ	4,600	3,130.000	14,398,000
フロンティア・マネジメント	3,500	923.000	3,230,500
カーブスホールディングス	25,500	790.000	20,145,000
FAST FITNESS JAPAN	3,400	1,608.000	5,467,200
ダイレクトマーケティングミックス	10,300	1,205.000	12,411,500
LITALICO	6,500	2,329.000	15,138,500
リログループ	45,400	2,061.000	93,569,400
東祥	6,900	1,304.000	8,997,600

ビーウィズ	2,200	2,111.000	4,644,200	
TREホールディングス	17,600	1,183.000	20,820,800	
人・夢・技術グループ	4,200	1,492.000	6,266,400	
大栄環境	15,900	1,870.000	29,733,000	
日本管財ホールディングス	8,300	2,574.000	21,364,200	
エイチ・アイ・エス	21,500	2,034.000	43,731,000	
ラックランド	3,100	3,120.000	9,672,000	
共立メンテナンス	14,000	5,530.000	77,420,000	
イチネンホールディングス	9,100	1,331.000	12,112,100	
建設技術研究所	4,400	3,120.000	13,728,000	
スペース	7,400	922.000	6,822,800	
燦ホールディングス	3,900	2,266.000	8,837,400	
スバル興業	800	9,250.000	7,400,000	
東京テアトル	9,000	1,121.000	10,089,000	
ナガワ	2,200	6,220.000	13,684,000	
東京都競馬	7,000	4,190.000	29,330,000	
カナモト	14,900	2,254.000	33,584,600	
ニシオホールディングス	7,600	3,165.000	24,054,000	
トランス・コスモス	10,200	3,085.000	31,467,000	
乃村工藝社	35,600	929.000	33,072,400	
藤田観光	4,100	3,580.000	14,678,000	
KNT-CTホールディングス	5,800	1,561.000	9,053,800	
トーカイ	7,500	1,994.000	14,955,000	
セコム	82,400	8,591.000	707,898,400	
セントラル警備保障	4,700	2,750.000	12,925,000	
丹青社	16,800	801.000	13,456,800	
メイテック	32,500	2,284.000	74,230,000	
応用地質	7,900	2,023.000	15,981,700	
船井総研ホールディングス	16,900	2,566.000	43,365,400	
いであ	2,800	1,628.000	4,558,400	
学究社	4,200	2,122.000	8,912,400	
ベネッセホールディングス	31,100	1,925.000	59,867,500	
イオンディライト	9,100	2,970.000	27,027,000	
ダイセキ	16,600	3,730.000	61,918,000	
ステップ	3,700	1,875.000	6,937,500	
合 計	92,214,900		228,784,745,920	

(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)

(2022年4月26日現在)

(2023年4月26日現在)

資産の部

流動資産		
預金	3,823,150,343	6,702,892,516
金銭信託	3,335,998	9,800,314
コール・ローン	168,265,306	439,699,703
株式	367,861,655,320	452,176,827,385
投資証券	10,140,612,029	10,366,469,694
派生商品評価勘定	23,850,169	242,734,524
未収入金	9,336,624	218,330,537
未収配当金	411,028,428	659,494,557
差入委託証拠金	1,745,293,514	2,627,423,933
流動資産合計	384,186,527,731	473,443,673,163
資産合計		
	384,186,527,731	473,443,673,163
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	134,319,687	23,659,454
未払金	-	212,695,934
未払解約金	600,406,328	594,926,603
その他未払費用	1,452	1,889
流動負債合計	734,727,467	831,283,880
負債合計		
	734,727,467	831,283,880
純資産の部		
元本等		
元本	63,556,720,108	75,868,330,761
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	319,895,080,156	396,744,058,522
元本等合計	383,451,800,264	472,612,389,283
純資産合計		
	383,451,800,264	472,612,389,283
負債純資産合計		
	384,186,527,731	473,443,673,163

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年4月27日 至 2023年4月26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>

	(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。 (2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
3. 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。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年4月26日現在)	(2023年4月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	63,556,720,108口	75,868,330,761口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 6.0332円 (1万口当たりの純資産額60,332円)	1口当たり純資産額 6.2294円 (1万口当たりの純資産額62,294円)

(金融商品に関する注記)

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年4月27日 至 2023年4月26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、投資証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、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、先物取引、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

	<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>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年4月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（株式、投資証券）</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)

(2022年4月26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 JUN22	4,122,572,256	-	4,025,998,515	96,573,741
	SPI 200 FUTURES JUN22	205,615,274	-	201,609,513	4,005,761
	FTSE 100 IDX FUT JUN22	241,938,385	-	239,617,512	2,320,873
	EURO STOXX 50 JUN22	756,038,201	-	741,472,116	14,566,085
	小計	5,326,164,116	-	5,208,697,656	117,466,460
	合 計	5,326,164,116	-	5,208,697,656	117,466,460

(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				
	スウェーデン・ク ローナ	135,101	-	131,500	3,601
	小計	135,101	-	131,500	3,601
	売建				
	アメリカ・ドル	448,816,113	-	446,564,421	2,251,692
	カナダ・ドル	25,292,154	-	25,049,920	242,234
	オーストラリア・ド ル	13,173,611	-	12,847,550	326,061
	香港・ドル	6,537,970	-	6,503,796	34,174
	シンガポール・ドル	3,743,098	-	3,718,220	24,878
	ニュージーランド・ ドル	863,930	-	845,570	18,360
	イギリス・ポンド	42,843,978	-	42,284,300	559,678
	イスラエル・シュケ ル	1,570,470	-	1,554,316	16,154
	スイス・フラン	45,708,002	-	45,326,920	381,082
	デンマーク・クロー ネ	5,753,758	-	5,704,369	49,389
	ノルウェー・クロー ネ	3,111,615	-	3,081,875	29,740

	スウェーデン・ク ローナ	6,680,540	-	6,575,000	105,540
	ユーロ	168,588,696	-	165,627,135	2,961,561
	小計	772,683,935	-	765,683,392	7,000,543
	合 計	772,819,036	-	765,814,892	6,996,942

(2023年4月26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	7,212,730,844	-	7,338,869,790	126,138,946
	SPI 200 FUTURES JUN23	364,385,196	-	375,114,671	10,729,475
	FTSE 100 IDX FUT JUN23	441,521,738	-	458,324,724	16,802,986
	EURO STOXX 50 JUN23	1,514,005,935	-	1,578,258,906	64,252,971
	小計	9,532,643,713	-	9,750,568,091	217,924,378
	合 計	9,532,643,713	-	9,750,568,091	217,924,378

(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 売建				
	アメリカ・ドル	273,095,473	-	272,826,452	269,021
	カナダ・ドル	29,195,825	-	28,962,303	233,522
	イギリス・ポンド	107,876,898	-	107,375,278	501,620
	ユーロ	59,424,831	-	59,278,301	146,530
	小計	469,593,027	-	468,442,334	1,150,693
	合 計	469,593,027	-	468,442,334	1,150,693

(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。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2022年4月27日 至 2023年4月26日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2022年4月26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	57,943,987,779円
同期中における追加設定元本額	15,824,942,750円
同期中における一部解約元本額	10,212,210,421円
2022年4月26日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	32,824,989,661円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	257,317,370円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,047,578,763円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	747,973,617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)	60,989,172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)	1,125,866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)	5,363,638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)	16,244,720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)	43,713,957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)	47,361,014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)	93,028,840円
外国株式指数ファンド	854,964,510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	14,459,619,207円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	96,142,646円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	103,195,277円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	68,329,125円

三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2050	15,569,633円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	120,600,881円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	105,362,465円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	367,489,080円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	193,274,372円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	223,259,235円
三井住友・D C つみたてN I S A ・世界分散ファンド	43,921,433円
三井住友D S ・外国株式インデックス年金ファンド	772,040,864円
三井住友D S ・年金バランス30(債券重点型)	4,693,304円
三井住友D S ・年金バランス50(標準型)	20,205,997円
三井住友D S ・年金バランス70(株式重点型)	19,677,700円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2060	1,976,165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)	178,127,088円
日興F W S ・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	162,944,584円
日興F W S ・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	556,407,030円
三井住友D S ・先進国株式インデックス・ファンド	20,929,896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)	502,987,590円
バランスファンドV A (安定運用型) <適格機関投資家限定>	4,946,844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>	25,733,245円
S M A M ・バランスファンドV A 25 <適格機関投資家専用>	622,840,510円
S M A M ・バランスファンドV A 37.5 <適格機関投資家専用>	760,966,204円
S M A M ・バランスファンドV A 50 <適格機関投資家専用>	3,294,948,550円
S M A M ・バランスファンドV L 30 <適格機関投資家限定>	10,889,499円
S M A M ・バランスファンドV L 50 <適格機関投資家限定>	56,580,424円
S M A M ・バランスファンドV A 75 <適格機関投資家専用>	444,174,100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>	37,545,497円
S M A M ・インデックス・バランスV A 25 <適格機関投資家専用>	93,355,655円
S M A M ・インデックス・バランスV A 50 <適格機関投資家専用>	445,662,014円
S M A M ・バランスファンドV A 40 <適格機関投資家専用>	324,389,117円
S M A M ・バランスファンドV A 35 <適格機関投資家専用>	750,605,330円
S M A M ・バランスV A 株40 T <適格機関投資家限定>	200,225円
三井住友・外国株式インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	208,063,748円
S M A M ・グローバルバランス40 V A <適格機関投資家限定>	67,237,428円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 20 A <適格機関投資家専用>	8,668,847円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 35 A <適格機関投資家専用>	7,431,222円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 50 A <適格機関投資家専用>	3,930,927円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 20 L <適格機関投資家専用>	20,254,181円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 25 L <適格機関投資家専用>	55,967,394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>	114,373,759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>	52,566,720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>	494,019,000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>	93,680,381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>	1,402,985,029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>	22,195,395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>	14,310,453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>	18,636,428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>	62,157,282円
合計	63,556,720,108円

(2023年4月26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	63,556,720,108円
同期中における追加設定元本額	22,882,025,465円
同期中における一部解約元本額	10,570,414,812円
2023年4月26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	38,000,129,125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)	831,380,132円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	34,107,550円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	984,101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)	5,026,458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)	15,450,395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)	44,487,949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)	53,550,838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)	110,637,272円
外国株式指数ファンド	981,891,869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	19,613,006,783円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	98,647,755円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	137,664,681円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	85,754,219円
イオン・バランス戦略ファンド	27,693,062円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	24,013,179円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	143,451,431円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	129,678,228円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	476,953,561円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	260,048,259円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	301,879,419円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	60,337,638円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	1,968,168,326円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	11,779,774円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	53,826,792円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	49,329,167円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	3,035,727円
SMB C・DCインデックスファンド(MSCIコクサイ)	634,513,472円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	319,915,262円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	1,813,910,204円
三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド	72,066,098円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	20,612円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	24,584円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	30,826円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	38,462円

三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	38,462円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	10,556円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	15,546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)	18,945円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	21,986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)	25,027円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	410,594,212円
バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉	3,298,003円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型〈適格機関投資家限定〉	18,661,339円
SMAM・バランスファンドVA25〈適格機関投資家専用〉	465,973,019円
SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉	665,541,241円
SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉	2,896,070,331円
SMAM・バランスファンドVL30〈適格機関投資家限定〉	9,822,476円
SMAM・バランスファンドVL50〈適格機関投資家限定〉	47,808,223円
SMAM・バランスファンドVA75〈適格機関投資家専用〉	397,658,711円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型〈適格機関投資家限定〉	35,766,460円
SMAM・インデックス・バランスVA25〈適格機関投資家専用〉	84,832,561円
SMAM・インデックス・バランスVA50〈適格機関投資家専用〉	411,687,872円
SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉	279,773,836円
SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉	633,254,726円
SMAM・バランスVA株40T〈適格機関投資家限定〉	195,290円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	184,292,025円
SMAM・グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉	56,631,240円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A〈適格機関投資家専用〉	7,051,860円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A〈適格機関投資家専用〉	6,575,296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〉	100,881,036円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA〈適格機関投資家限定〉	44,957,268円
SMAM・世界バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	229,339,986円
SMAM・世界バランスファンドVA2〈適格機関投資家限定〉	68,183,758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〉	678,535,453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〉	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〉	14,979,993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〉	19,482,776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〉	208,960,218円
合 計	75,868,330,761円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
	APA CORP	19,759	36.280	716,856.52	

アメリカ・
ドル

BAKER HUGHES CO	69,679	29.290	2,040,897.91	
CHENIERE ENERGY INC	14,977	149.520	2,239,361.04	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	7,695	79.820	614,214.90	
CHEVRON CORP	127,235	168.990	21,501,442.65	
CONOCOPHILLIPS	86,690	102.090	8,850,182.10	
COTERRA ENERGY INC	49,908	25.150	1,255,186.20	
DEVON ENERGY CORP	44,032	53.210	2,342,942.72	
DIAMONDBACK ENERGY INC	11,049	139.330	1,539,457.17	
EOG RESOURCES INC	39,908	116.670	4,656,066.36	
EQT CORP	19,298	31.710	611,939.58	
EXXON MOBIL CORP	284,707	116.520	33,174,059.64	
HALLIBURTON CO	59,461	33.250	1,977,078.25	
HESS CORP	18,976	141.170	2,678,841.92	
HF SINCLAIR CORP	10,663	43.800	467,039.40	
KINDER MORGAN INC	138,727	17.410	2,415,237.07	
MARATHON OIL CORP	42,380	23.740	1,006,101.20	
MARATHON PETROLEUM CORP	33,195	123.150	4,087,964.25	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	51,961	61.330	3,186,768.13	
ONEOK INC	31,946	65.550	2,094,060.30	
OVINTIV INC	16,672	35.830	597,357.76	
PHILLIPS 66	33,814	99.320	3,358,406.48	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	15,440	222.440	3,434,473.60	
SCHLUMBERGER LTD	99,086	48.960	4,851,250.56	
TARGA RESOURCES CORP	15,416	75.510	1,164,062.16	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	417	1,513.030	630,933.51	
VALERO ENERGY CORP	27,588	117.850	3,251,245.80	
WILLIAMS COS INC	82,707	29.930	2,475,420.51	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	15,122	289.940	4,384,472.68	
ALBEMARLE CORP	8,338	176.660	1,472,991.08	
ALCOA CORP	11,849	35.750	423,601.75	
AMCOR PLC	97,610	10.820	1,056,140.20	
AVERY DENNISON CORP	5,454	170.830	931,706.82	
BALL CORP	23,469	51.740	1,214,286.06	
CELANESE CORP	6,643	100.510	667,687.93	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	14,020	72.330	1,014,066.60	
CLEVELAND-CLIFFS INC	33,403	15.270	510,063.81	
CORTEVA INC	48,566	60.530	2,939,699.98	
CROWN HOLDINGS INC	9,413	81.270	764,994.51	
DOW INC	48,964	52.500	2,570,610.00	
DUPONT DE NEMOURS INC	34,201	67.990	2,325,325.99	
EASTMAN CHEMICAL CO	9,517	79.860	760,027.62	
ECOLAB INC	18,131	164.300	2,978,923.30	
FMC CORP	8,548	122.030	1,043,112.44	
FREEMPORT-MCMORAN INC	99,638	37.750	3,761,334.50	

INTERNATIONAL PAPER CO	23,472	34.690	814,243.68	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	17,659	95.530	1,686,964.27	
LINDE PLC	33,937	367.060	12,456,915.22	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	17,144	91.000	1,560,104.00	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,203	352.520	1,481,641.56	
MOSAIC CO/THE	25,489	42.670	1,087,615.63	
NEWMONT CORP	55,957	48.200	2,697,127.40	
NUCOR CORP	17,484	147.950	2,586,757.80	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,111	134.380	955,576.18	
PPG INDUSTRIES INC	16,735	140.430	2,350,096.05	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	4,056	240.700	976,279.20	
RPM INTERNATIONAL INC	7,696	80.330	618,219.68	
SEALED AIR CORP	7,895	46.340	365,854.30	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	17,193	234.790	4,036,744.47	
STEEL DYNAMICS INC	12,713	104.000	1,322,152.00	
VULCAN MATERIALS CO	8,762	169.670	1,486,648.54	
WESTLAKE CORP	2,189	110.540	241,972.06	
WESTROCK CO	16,766	29.520	494,932.32	
3M CO	37,053	104.370	3,867,221.61	
AECOM	10,261	81.570	836,989.77	
AERCAP HOLDINGS NV	10,065	54.020	543,711.30	
ALLEGION PLC	6,843	101.950	697,643.85	
AMETEK INC	16,587	135.920	2,254,505.04	
AXON ENTERPRISE INC	4,672	220.850	1,031,811.20	
BOEING CO/THE	38,897	202.190	7,864,584.43	
CARLISLE COS INC	3,499	213.590	747,351.41	
CARRIER GLOBAL CORP	55,822	42.320	2,362,387.04	
CATERPILLAR INC	36,294	218.630	7,934,957.22	
CUMMINS INC	10,159	233.460	2,371,720.14	
DEERE & CO	20,015	379.470	7,595,092.05	
DOVER CORP	10,436	145.460	1,518,020.56	
EATON CORP PLC	28,066	163.780	4,596,649.48	
EMERSON ELECTRIC CO	39,768	84.520	3,361,191.36	
FASTENAL CO	41,551	53.510	2,223,394.01	
FERGUSON PLC	14,464	135.200	1,955,532.80	
FORTIVE CORP	21,981	65.320	1,435,798.92	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	7,166	60.030	430,174.98	
GENERAC HOLDINGS INC	3,973	102.100	405,643.30	
GENERAL DYNAMICS CORP	15,874	222.740	3,535,774.76	
GENERAL ELECTRIC CO	74,672	98.440	7,350,711.68	
GRACO INC	11,645	70.090	816,198.05	
HEICO CORP	3,085	168.090	518,557.65	
HEICO CORP-CLASS A	4,570	133.650	610,780.50	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	45,877	195.960	8,990,056.92	

HOWMET AEROSPACE INC	23,889	42.990	1,026,988.11	
HUBBELL INC	3,897	259.410	1,010,920.77	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,888	206.380	596,025.44	
IDEX CORP	4,788	215.370	1,031,191.56	
ILLINOIS TOOL WORKS	20,720	235.030	4,869,821.60	
INGERSOLL-RAND INC	29,314	54.440	1,595,854.16	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	11,600	48.720	565,152.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	46,593	58.300	2,716,371.90	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	12,963	199.320	2,583,785.16	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,104	258.980	544,893.92	
LOCKHEED MARTIN CORP	16,474	475.580	7,834,704.92	
MASCO CORP	14,885	50.240	747,822.40	
NORDSON CORP	3,927	214.150	840,967.05	
NORTHROP GRUMMAN CORP	10,242	465.470	4,767,343.74	
OTIS WORLDWIDE CORP	28,787	82.650	2,379,245.55	
OWENS CORNING	7,597	99.950	759,320.15	
PACCAR INC	36,912	74.800	2,761,017.60	
PARKER HANNIFIN CORP	8,744	317.110	2,772,809.84	
PENTAIR PLC	11,509	53.320	613,659.88	
PLUG POWER INC	28,584	8.910	254,683.44	
QUANTA SERVICES INC	10,416	167.220	1,741,763.52	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	100,547	101.090	10,164,296.23	
ROCKWELL AUTOMATION INC	7,930	274.930	2,180,194.90	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	12,538	44.140	553,427.32	
SMITH (A.O.) CORP	7,157	68.570	490,755.49	
SNAP-ON INC	4,041	257.850	1,041,971.85	
STANLEY BLACK & DECKER INC	9,129	77.660	708,958.14	
TEXTRON INC	14,870	67.200	999,264.00	
TORO CO	8,097	103.000	833,991.00	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	15,733	178.840	2,813,689.72	
TRANSDIGM GROUP INC	3,706	754.000	2,794,324.00	
UNITED RENTALS INC	4,798	377.640	1,811,916.72	
WABTEC CORP	11,284	100.780	1,137,201.52	
WW GRAINGER INC	3,160	671.830	2,122,982.80	
XYLEM INC	12,201	102.920	1,255,726.92	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	28,752	211.690	6,086,510.88	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	8,029	96.130	771,827.77	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	7,244	141.190	1,022,780.36	
CINTAS CORP	6,178	447.020	2,761,689.56	
CLARIVATE PLC	19,939	8.680	173,070.52	
COPART INC	31,082	77.530	2,409,787.46	
COSTAR GROUP INC	28,273	68.500	1,936,700.50	
EQUIFAX INC	7,922	198.030	1,568,793.66	
JACOBS SOLUTIONS INC	8,422	113.730	957,834.06	

LEIDOS HOLDINGS INC	8,863	91.410	810,166.83	
PAYCHEX INC	22,937	107.950	2,476,049.15	
REPUBLIC SERVICES INC	16,065	138.880	2,231,107.20	
ROBERT HALF INTL INC	8,149	71.700	584,283.30	
ROLLINS INC	16,081	39.720	638,737.32	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	14,487	55.530	804,463.11	
TRANSUNION	14,503	63.070	914,704.21	
VERISK ANALYTICS INC	11,250	192.710	2,167,987.50	
WASTE CONNECTIONS INC	18,291	141.300	2,584,518.30	
WASTE MANAGEMENT INC	28,817	165.570	4,771,230.69	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,726	95.860	836,474.36	
CSX CORP	145,813	30.900	4,505,621.70	
DELTA AIR LINES INC	8,299	33.110	274,779.89	
EXPEDITORS INTL WASH INC	10,436	109.670	1,144,516.12	
FEDEX CORP	16,733	225.470	3,772,789.51	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	96,661	2.770	267,750.97	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	5,530	172.550	954,201.50	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	12,089	55.000	664,895.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	15,994	207.120	3,312,677.28	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	6,292	339.370	2,135,316.04	
SOUTHWEST AIRLINES CO	7,076	31.290	221,408.04	
UBER TECHNOLOGIES INC	104,406	29.590	3,089,373.54	
U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING	5,850	53.700	314,145.00	
UNION PACIFIC CORP	42,525	194.750	8,281,743.75	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	49,837	176.290	8,785,764.73	
APTIV PLC	18,724	102.320	1,915,839.68	
BORGWARNER INC	17,433	48.350	842,885.55	
FORD MOTOR CO	276,446	11.770	3,253,769.42	
GENERAL MOTORS CO	96,958	32.910	3,190,887.78	
LEAR CORP	3,736	131.560	491,508.16	
LUCID GROUP INC	21,730	6.740	146,460.20	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	19,354	12.000	232,248.00	
TESLA INC	185,930	160.670	29,873,373.10	
DR HORTON INC	23,515	108.210	2,544,558.15	
GARMIN LTD	10,774	96.080	1,035,165.92	
HASBRO INC	7,491	51.040	382,340.64	
LENNAR CORP-A	17,126	111.010	1,901,157.26	
LULULEMON ATHLETICA INC	8,357	372.810	3,115,573.17	
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	95.470	273,330.61	
NEWELL BRANDS INC	26,997	11.900	321,264.30	
NIKE INC -CL B	86,051	124.660	10,727,117.66	
NVR INC	204	5,754.710	1,173,960.84	
PULTEGROUP INC	17,535	64.950	1,138,898.25	
VF CORP	20,583	22.310	459,206.73	

WHIRLPOOL CORP	3,212	132.550	425,750.60	
AIRBNB INC-CLASS A	25,852	112.505	2,908,479.26	
ARAMARK	13,242	34.080	451,287.36	
BOOKING HOLDINGS INC	2,713	2,645.020	7,175,939.26	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	13,336	42.220	563,045.92	
CARNIVAL CORP	69,745	8.960	624,915.20	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,953	1,780.000	3,476,340.00	
DARDEN RESTAURANTS INC	7,606	146.460	1,113,974.76	
DOMINO'S PIZZA INC	2,121	329.630	699,145.23	
DOORDASH INC - A	16,981	56.820	964,860.42	
EXPEDIA GROUP INC	10,081	92.110	928,560.91	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	19,380	146.330	2,835,875.40	
LAS VEGAS SANDS CORP	23,449	62.410	1,463,452.09	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	18,185	172.860	3,143,459.10	
MCDONALD'S CORP	50,614	291.510	14,754,487.14	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,198	43.440	964,281.12	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,097	60.390	972,097.83	
STARBUCKS CORP	79,076	109.340	8,646,169.84	
VAIL RESORTS INC	2,860	241.240	689,946.40	
WYNN RESORTS LTD	7,730	111.630	862,899.90	
YUM! BRANDS INC	20,179	137.810	2,780,867.99	
ADVANCE AUTO PARTS INC	3,426	123.780	424,070.28	
AMAZON.COM INC	634,483	102.570	65,078,921.31	
AUTOZONE INC	1,315	2,678.340	3,522,017.10	
BATH & BODY WORKS INC	15,400	34.700	534,380.00	
BEST BUY CO INC	14,954	71.370	1,067,266.98	
BURLINGTON STORES INC	4,802	185.310	889,858.62	
CARMAX INC	10,366	67.360	698,253.76	
CHEWY INC - CLASS A	3,969	31.250	124,031.25	
EBAY INC	35,551	44.010	1,564,599.51	
ETSY INC	9,090	98.370	894,183.30	
GENUINE PARTS CO	10,245	165.140	1,691,859.30	
HOME DEPOT INC	70,430	296.330	20,870,521.90	
LKQ CORP	15,922	56.550	900,389.10	
LOWE'S COS INC	42,268	205.880	8,702,135.84	
MERCADOLIBRE INC	3,170	1,229.550	3,897,673.50	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,265	897.760	3,828,946.40	
POOL CORP	2,578	336.920	868,579.76	
ROSS STORES INC	24,702	104.040	2,569,996.08	
TJX COMPANIES INC	80,320	76.840	6,171,788.80	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,071	244.370	1,972,310.27	
ULTA BEAUTY INC	3,734	541.860	2,023,305.24	
COSTCO WHOLESALE CORP	30,793	503.170	15,494,113.81	
DOLLAR GENERAL CORP	15,800	219.440	3,467,152.00	

DOLLAR TREE INC	15,923	152.360	2,426,028.28	
KROGER CO	44,568	47.970	2,137,926.96	
SYSCO CORP	36,352	74.970	2,725,309.44	
TARGET CORP	31,809	157.610	5,013,416.49	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	52,808	34.890	1,842,471.12	
WALMART INC	103,381	151.570	15,669,458.17	
ALTRIA GROUP INC	122,631	46.990	5,762,430.69	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	39,414	75.900	2,991,522.60	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	22,643	63.950	1,448,019.85	
BUNGE LTD	10,263	91.380	937,832.94	
CAMPBELL SOUP CO	12,945	54.670	707,703.15	
COCA-COLA CO/THE	285,588	63.850	18,234,793.80	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	13,260	63.280	839,092.80	
CONAGRA BRANDS INC	30,896	38.140	1,178,373.44	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	11,695	226.530	2,649,268.35	
DARLING INGREDIENTS INC	10,514	58.200	611,914.80	
GENERAL MILLS INC	42,268	88.500	3,740,718.00	
HERSHEY CO/THE	10,035	262.980	2,639,004.30	
HORMEL FOODS CORP	19,475	40.020	779,389.50	
JM SMUCKER CO/THE	6,647	154.340	1,025,897.98	
KELLOGG CO	15,843	68.550	1,086,037.65	
KEURIG DR PEPPER INC	53,534	35.890	1,921,335.26	
KRAFT HEINZ CO/THE	48,205	39.440	1,901,205.20	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	10,534	109.790	1,156,527.86	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,425	85.840	1,581,602.00	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	12,477	58.710	732,524.67	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	93,332	72.500	6,766,570.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	52,042	54.210	2,821,196.82	
PEPSICO INC	94,583	189.710	17,943,340.93	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	108,150	98.690	10,673,323.50	
TYSON FOODS INC-CL A	19,731	61.000	1,203,591.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	17,113	92.480	1,582,610.24	
CLOROX COMPANY	9,104	164.900	1,501,249.60	
COLGATE-PALMOLIVE CO	55,341	77.700	4,299,995.70	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	15,603	247.050	3,854,721.15	
KIMBERLY-CLARK CORP	22,991	144.670	3,326,107.97	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	164,482	156.390	25,723,339.98	
ABBOTT LABORATORIES	121,493	109.970	13,360,585.21	
ALIGN TECHNOLOGY INC	4,914	351.520	1,727,369.28	
AMERISOURCEBERGEN CORP	10,249	168.090	1,722,754.41	
BAXTER INTERNATIONAL INC	33,018	45.440	1,500,337.92	
BECTON DICKINSON AND CO	19,828	260.930	5,173,720.04	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	99,665	51.110	5,093,878.15	
CARDINAL HEALTH INC	18,000	80.880	1,455,840.00	

CENTENE CORP	40,300	69.290	2,792,387.00	
COOPER COS INC/THE	3,384	379.010	1,282,569.84	
CVS HEALTH CORP	91,978	72.870	6,702,436.86	
DAVITA INC	4,138	87.300	361,247.40	
DENTSPLY SIRONA INC	11,864	40.970	486,068.08	
DEXCOM INC	27,694	123.960	3,432,948.24	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	44,049	87.770	3,866,180.73	
ELEVANCE HEALTH INC	16,551	460.870	7,627,859.37	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	26,484	80.390	2,129,048.76	
HCA HEALTHCARE INC	15,058	281.990	4,246,205.42	
HENRY SCHEIN INC	10,457	83.630	874,518.91	
HOLOGIC INC	16,591	84.910	1,408,741.81	
HUMANA INC	8,820	501.690	4,424,905.80	
IDEXX LABORATORIES INC	5,548	483.230	2,680,960.04	
INSULET CORP	5,082	321.330	1,632,999.06	
INTUITIVE SURGICAL INC	24,730	294.970	7,294,608.10	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	6,245	221.400	1,382,643.00	
MASIMO CORP	2,941	190.940	561,554.54	
MCKESSON CORP	10,067	363.290	3,657,240.43	
MEDTRONIC PLC	91,754	89.690	8,229,416.26	
MOLINA HEALTHCARE INC	3,809	279.280	1,063,777.52	
NOVOCURE LTD	6,929	60.960	422,391.84	
QUEST DIAGNOSTICS INC	7,645	146.500	1,119,992.50	
RESMED INC	9,600	226.610	2,175,456.00	
STERIS PLC	6,271	181.840	1,140,318.64	
STRYKER CORP	23,557	299.490	7,055,085.93	
TELEFLEX INC	3,067	268.340	822,998.78	
THE CIGNA GROUP	21,108	253.710	5,355,310.68	
UNITEDHEALTH GROUP INC	64,776	491.920	31,864,609.92	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,203	140.720	591,446.16	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	9,184	178.840	1,642,466.56	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	13,599	139.060	1,891,076.94	
ABBVIE INC	122,871	164.900	20,261,427.90	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	21,101	130.370	2,750,937.37	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7,912	202.150	1,599,410.80	
AMGEN INC	36,847	244.870	9,022,724.89	
AVANTOR INC	44,191	18.870	833,884.17	
BIOGEN INC	9,574	282.410	2,703,793.34	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	13,832	95.570	1,321,924.24	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,728	437.270	755,602.56	
BIO-TECHNE CORP	10,204	78.730	803,360.92	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	145,406	70.240	10,213,317.44	
CATALENT INC	10,797	42.360	457,360.92	
CHARLES RIVER LABORATORIES	3,467	187.600	650,409.20	

DANAHER CORP	47,447	231.990	11,007,229.53	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	20,811	9.330	194,166.63	
ELI LILLY & CO	56,126	384.840	21,599,529.84	
EXACT SCIENCES CORP	13,570	63.550	862,373.50	
GILEAD SCIENCES INC	86,583	85.590	7,410,638.97	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	13,945	110.580	1,542,038.10	
ILLUMINA INC	10,327	218.690	2,258,411.63	
INCYTE CORP	11,842	73.550	870,979.10	
IQVIA HOLDINGS INC	12,401	191.710	2,377,395.71	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,089	141.180	577,285.02	
JOHNSON & JOHNSON	181,319	165.180	29,950,272.42	
MERCK & CO. INC.	176,126	116.530	20,523,962.78	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,476	1,470.330	2,170,207.08	
MODERNA INC	21,941	134.900	2,959,840.90	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,359	102.370	650,970.83	
PERKINELMER INC	8,323	127.520	1,061,348.96	
PFIZER INC	390,323	39.330	15,351,403.59	
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,436	789.580	5,871,316.88	
REPLIGEN CORP	3,456	149.550	516,844.80	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	27,162	35.600	966,967.20	
SEAGEN INC	8,954	203.200	1,819,452.80	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	82,214	8.230	676,621.22	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	27,288	548.380	14,964,193.44	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,537	226.310	800,458.47	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	17,790	331.930	5,905,034.70	
VIATRIS INC	83,466	9.180	766,217.88	
WATERS CORP	4,095	292.710	1,198,647.45	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,276	357.000	1,883,532.00	
ZOETIS INC	32,496	173.020	5,622,457.92	
BANK OF AMERICA CORP	501,898	28.840	14,474,738.32	
CITIGROUP INC	133,869	47.900	6,412,325.10	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	36,122	28.870	1,042,842.14	
FIFTH THIRD BANCORP	49,541	25.660	1,271,222.06	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	670	990.060	663,340.20	
FIRST HORIZON CORP	39,014	17.590	686,256.26	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	11,979	8.100	97,029.90	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	105,007	10.940	1,148,776.58	
JPMORGAN CHASE & CO	203,194	137.670	27,973,717.98	
KEYCORP	62,741	10.480	657,525.68	
M & T BANK CORP	12,629	120.010	1,515,606.29	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	27,928	123.700	3,454,693.60	
REGIONS FINANCIAL CORP	62,979	17.810	1,121,655.99	
TRUIST FINANCIAL CORP	92,408	30.430	2,811,975.44	
US BANCORP	96,119	31.770	3,053,700.63	

WEBSTER FINANCIAL CORP	13,918	36.120	502,718.16	
WELLS FARGO & CO	265,487	40.550	10,765,497.85	
ALLY FINANCIAL INC	20,139	25.580	515,155.62	
AMERICAN EXPRESS CO	43,398	156.120	6,775,295.76	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,131	290.010	2,068,061.31	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	27,656	61.630	1,704,439.28	
ARES MANAGEMENT CORP - A	11,370	83.270	946,779.90	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	54,315	42.490	2,307,844.35	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	90,305	324.340	29,289,523.70	
BLACKROCK INC	10,403	659.710	6,862,963.13	
BLACKSTONE INC	47,782	86.430	4,129,798.26	
BLOCK INC	38,443	61.000	2,345,023.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	27,026	94.950	2,566,118.70	
CARLYLE GROUP INC/THE	16,730	29.280	489,854.40	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	7,323	139.100	1,018,629.30	
CME GROUP INC	25,066	187.790	4,707,144.14	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	7,252	55.550	402,848.60	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	18,645	101.780	1,897,688.10	
EQUITABLE HOLDINGS INC	22,820	25.210	575,292.20	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,377	412.070	979,490.39	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	42,749	55.280	2,363,164.72	
FISERV INC	42,333	120.090	5,083,769.97	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,371	209.310	914,894.01	
FRANKLIN RESOURCES INC	21,778	26.240	571,454.72	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	5,375	42.930	230,748.75	
GLOBAL PAYMENTS INC	18,157	105.720	1,919,558.04	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	23,245	339.480	7,891,212.60	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	38,979	106.340	4,145,026.86	
INVESCO LTD	18,328	16.800	307,910.40	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,971	155.930	775,128.03	
KKR & CO INC	37,308	51.040	1,904,200.32	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	4,992	200.510	1,000,945.92	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,653	315.760	837,711.28	
MASTERCARD INC - A	59,607	368.530	21,966,967.71	
MOODY'S CORP	11,246	306.450	3,446,336.70	
MORGAN STANLEY	88,738	88.060	7,814,268.28	
MSCI INC	5,669	471.150	2,670,949.35	
NASDAQ INC	22,924	55.270	1,267,009.48	
NORTHERN TRUST CORP	13,026	78.160	1,018,112.16	
PAYPAL HOLDINGS INC	76,064	71.780	5,459,873.92	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	12,735	91.370	1,163,596.95	
S&P GLOBAL INC	23,240	345.210	8,022,680.40	
SCHWAB (CHARLES) CORP	100,352	51.030	5,120,962.56	
SEI INVESTMENTS COMPANY	7,550	57.910	437,220.50	

STATE STREET CORP	24,045	70.620	1,698,057.90	
SYNCHRONY FINANCIAL	32,112	29.140	935,743.68	
T ROWE PRICE GROUP INC	14,797	109.350	1,618,051.95	
TOAST INC-CLASS A	21,393	17.250	369,029.25	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	8,688	70.350	611,200.80	
VISA INC-CLASS A SHARES	112,974	229.590	25,937,700.66	
AFLAC INC	40,880	65.770	2,688,677.60	
ALLSTATE CORP	18,070	114.910	2,076,423.70	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,866	119.830	583,092.78	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	50,566	50.950	2,576,337.70	
AON PLC-CLASS A	14,138	330.380	4,670,912.44	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	25,320	72.590	1,837,978.80	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,270	207.190	2,956,601.30	
ASSURANT INC	3,114	116.580	363,030.12	
BROWN & BROWN INC	18,424	63.010	1,160,896.24	
CHUBB LTD	28,440	201.180	5,721,559.20	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,510	103.550	1,088,310.50	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,288	221.630	285,459.44	
EVEREST RE GROUP LTD	2,755	370.000	1,019,350.00	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	19,058	34.370	655,023.46	
GLOBE LIFE INC	6,373	106.220	676,940.06	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	21,767	69.090	1,503,882.03	
LOEWS CORP	12,727	56.110	714,111.97	
MARKEL CORP	837	1,318.450	1,103,542.65	
MARSH & MCLENNAN COS	34,900	177.800	6,205,220.00	
METLIFE INC	47,592	59.210	2,817,922.32	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	16,409	73.160	1,200,482.44	
PROGRESSIVE CORP	41,143	134.870	5,548,956.41	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	24,389	83.880	2,045,749.32	
TRAVELERS COS INC/THE	16,719	177.320	2,964,613.08	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	7,897	239.590	1,892,042.23	
WR BERKLEY CORP	14,486	57.630	834,828.18	
ACCENTURE PLC-CL A	43,075	270.700	11,660,402.50	
ADOBE INC	32,139	369.590	11,878,253.01	
AKAMAII TECHNOLOGIES INC	10,300	79.470	818,541.00	
ANSYS INC	5,908	312.700	1,847,431.60	
ASPEN TECHNOLOGY INC	1,901	232.330	441,659.33	
ATLASSIAN CORP-CL A	10,941	143.060	1,565,219.46	
AUTODESK INC	14,728	190.210	2,801,412.88	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	11,682	40.890	477,676.98	
BILL HOLDINGS INC	6,004	73.040	438,532.16	
BLACK KNIGHT INC	10,656	54.750	583,416.00	
CADENCE DESIGN SYS INC	19,198	203.900	3,914,472.20	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,485	62.380	654,054.30	

CHECK POINT SOFTWARE TECH	7,561	126.070	953,215.27	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	19,210	58.090	1,115,908.90	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	36,763	58.460	2,149,164.98	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	14,965	122.150	1,827,974.75	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,173	121.500	385,519.50	
DATADOG INC - CLASS A	16,206	62.690	1,015,954.14	
DOCUSIGN INC	12,031	49.150	591,323.65	
DROPBOX INC-CLASS A	16,584	21.070	349,424.88	
DYNATRACE INC	15,753	40.840	643,352.52	
EPAM SYSTEMS INC	3,733	273.970	1,022,730.01	
FAIR ISAAC CORP	1,871	709.520	1,327,511.92	
FORTINET INC	47,604	63.170	3,007,144.68	
GARTNER INC	5,357	294.890	1,579,725.73	
GEN DIGITAL INC	41,779	17.360	725,283.44	
GODADDY INC - CLASS A	11,895	74.840	890,221.80	
HUBSPOT INC	3,318	401.850	1,333,338.30	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	62,270	125.890	7,839,170.30	
INTUIT INC	18,486	419.830	7,760,977.38	
MICROSOFT CORP	489,744	275.420	134,885,292.48	
MONGODB INC	4,150	212.910	883,576.50	
OKTA INC	10,337	69.880	722,349.56	
ORACLE CORP	112,929	94.060	10,622,101.74	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	128,742	7.740	996,463.08	
PALO ALTO NETWORKS INC	21,435	182.570	3,913,387.95	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,778	288.710	1,090,746.38	
PAYLOCITY HOLDING CORP	2,718	183.790	499,541.22	
PTC INC	7,295	124.210	906,111.95	
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,457	437.360	3,261,393.52	
SALESFORCE INC	68,700	190.670	13,099,029.00	
SERVICENOW INC	13,974	442.280	6,180,420.72	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	14,743	135.480	1,997,381.64	
SPLUNK INC	12,234	84.720	1,036,464.48	
SYNOPSYS INC	10,312	364.530	3,759,033.36	
TWILIO INC - A	10,905	52.730	575,020.65	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,139	364.010	1,142,627.39	
UNITY SOFTWARE INC	19,066	26.980	514,400.68	
VERISIGN INC	6,425	212.830	1,367,432.75	
VMWARE INC-CLASS A	13,809	126.130	1,741,729.17	
WIX.COM LTD	4,119	86.790	357,488.01	
WORKDAY INC-CLASS A	14,441	182.880	2,640,970.08	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	13,927	63.050	878,097.35	
ZSCALER INC	6,271	92.320	578,938.72	
AMPHENOL CORP-CL A	41,781	74.870	3,128,143.47	
APPLE INC	1,100,007	163.770	180,148,146.39	

ARISTA NETWORKS INC	16,665	153.580	2,559,410.70	
ARROW ELECTRONICS INC	4,130	111.350	459,875.50	
CDW CORP/DE	9,855	165.110	1,627,159.05	
CISCO SYSTEMS INC	281,989	47.090	13,278,862.01	
COGNEX CORP	11,368	47.310	537,820.08	
CORNING INC	58,470	32.890	1,923,078.30	
DELL TECHNOLOGIES -C	18,797	41.710	784,022.87	
F5 INC	3,921	130.290	510,867.09	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	86,138	14.140	1,217,991.32	
HP INC	69,711	29.260	2,039,743.86	
JUNIPER NETWORKS INC	21,151	30.980	655,257.98	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	11,811	141.970	1,676,807.67	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	11,763	289.300	3,403,035.90	
NETAPP INC	13,273	61.440	815,493.12	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	11,800	56.090	661,862.00	
TE CONNECTIVITY LTD	20,969	124.180	2,603,930.42	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,432	416.080	1,427,986.56	
TRIMBLE INC	15,566	45.820	713,234.12	
WESTERN DIGITAL CORP	24,533	32.090	787,263.97	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	3,257	284.100	925,313.70	
ADVANCED MICRO DEVICES	111,153	83.800	9,314,621.40	
ANALOG DEVICES INC	35,611	181.140	6,450,576.54	
APPLIED MATERIALS INC	59,454	110.610	6,576,206.94	
BROADCOM INC	28,817	622.020	17,924,750.34	
ENPHASE ENERGY INC	8,881	220.600	1,959,148.60	
ENTEGRIS INC	9,961	69.370	690,994.57	
FIRST SOLAR INC	6,859	210.530	1,444,025.27	
INTEL CORP	283,167	28.880	8,177,862.96	
KLA CORP	9,474	357.750	3,389,323.50	
LAM RESEARCH CORP	9,194	499.720	4,594,425.68	
MARVELL TECHNOLOGY INC	60,303	36.910	2,225,783.73	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	36,442	74.370	2,710,191.54	
MICRON TECHNOLOGY INC	76,774	58.140	4,463,640.36	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,887	450.820	1,301,517.34	
NVIDIA CORP	169,563	262.410	44,495,026.83	
NXP SEMICONDUCTORS NV	18,416	164.500	3,029,432.00	
ON SEMICONDUCTOR	31,206	70.350	2,195,342.10	
QORVO INC	6,042	89.690	541,906.98	
QUALCOMM INC	77,221	114.050	8,807,055.05	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	10,677	101.690	1,085,744.13	
SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	4,104	309.210	1,268,997.84	
TERADYNE INC	10,642	94.350	1,004,072.70	
TEXAS INSTRUMENTS INC	62,613	169.390	10,606,016.07	
WOLFSPEED INC	8,461	56.320	476,523.52	

AT&T INC	490,389	17.510	8,586,711.39	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	21,079	18.950	399,447.05	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	8,432	18.120	152,787.84	
T-MOBILE US INC	43,384	148.000	6,420,832.00	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	288,471	37.300	10,759,968.30	
AES CORP	41,893	23.870	999,985.91	
ALLIANT ENERGY CORP	16,641	55.750	927,735.75	
AMEREN CORPORATION	16,937	90.760	1,537,202.12	
AMERICAN ELECTRIC POWER	34,672	94.380	3,272,343.36	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	13,278	152.420	2,023,832.76	
ATMOS ENERGY CORP	8,726	116.270	1,014,572.02	
CENTERPOINT ENERGY INC	44,329	30.830	1,366,663.07	
CMS ENERGY CORP	20,578	62.630	1,288,800.14	
CONSOLIDATED EDISON INC	25,230	100.400	2,533,092.00	
CONSTELLATION ENERGY	22,424	76.930	1,725,078.32	
DOMINION ENERGY INC	56,137	57.310	3,217,211.47	
DTE ENERGY COMPANY	14,083	114.810	1,616,869.23	
DUKE ENERGY CORP	53,442	99.740	5,330,305.08	
EDISON INTERNATIONAL	24,655	73.770	1,818,799.35	
ENTERGY CORP	14,800	108.770	1,609,796.00	
ESSENTIAL UTILITIES INC	16,329	43.870	716,353.23	
EVERGY INC	17,275	63.680	1,100,072.00	
EVERSOURCE ENERGY	25,375	79.570	2,019,088.75	
EXELON CORP	69,982	43.610	3,051,915.02	
FIRSTENERGY CORP	37,970	41.140	1,562,085.80	
NEXTERA ENERGY INC	138,380	77.820	10,768,731.60	
NISOURCE INC	25,829	28.650	740,000.85	
NRG ENERGY INC	13,547	34.060	461,410.82	
P G & E CORP	108,132	17.270	1,867,439.64	
PPL CORP	47,199	28.700	1,354,611.30	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	33,085	63.900	2,114,131.50	
SEMPRA ENERGY	22,372	157.980	3,534,328.56	
SOUTHERN CO/THE	76,796	73.980	5,681,368.08	
UGI CORP	15,256	33.900	517,178.40	
VISTRA CORP	25,777	23.350	601,892.95	
WEC ENERGY GROUP INC	22,571	98.210	2,216,697.91	
XCEL ENERGY INC	37,222	71.180	2,649,461.96	
ACTIVISION BLIZZARD INC	54,622	86.740	4,737,912.28	
ALPHABET INC-CL A	412,760	103.850	42,865,126.00	
ALPHABET INC-CL C	377,716	104.610	39,512,870.76	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,703	323.940	2,495,309.82	
COMCAST CORP-CLASS A	300,293	36.900	11,080,811.70	
DISH NETWORK CORP-A	12,937	6.980	90,300.26	
ELECTRONIC ARTS INC	18,378	129.500	2,379,951.00	

FOX CORP - CLASS A	23,886	32.440	774,861.84		
FOX CORP - CLASS B	8,773	29.720	260,733.56		
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	26,027	37.000	962,999.00		
LIBERTY BROADBAND-C	8,196	74.540	610,929.84		
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	13,438	71.460	960,279.48		
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	4,141	27.360	113,297.76		
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	12,383	27.280	337,808.24		
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	11,080	66.400	735,712.00		
MATCH GROUP INC	17,799	33.170	590,392.83		
META PLATFORMS INC-CLASS A	155,983	207.550	32,374,271.65		
NETFLIX INC	30,569	322.550	9,860,030.95		
NEWS CORP - CLASS A	23,102	16.900	390,423.80		
OMNICOM GROUP	15,106	93.090	1,406,217.54		
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	40,964	21.970	899,979.08		
PINTEREST INC- CLASS A	38,300	27.740	1,062,442.00		
ROBLOX CORP -CLASS A	22,745	37.570	854,529.65		
ROKU INC	9,945	57.720	574,025.40		
SEA LTD-ADR	24,719	74.940	1,852,441.86		
SIRIUS XM HOLDINGS INC	56,550	3.690	208,669.50		
SNAP INC - A	85,415	10.160	867,816.40		
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	10,772	127.010	1,368,151.72		
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	32,608	59.370	1,935,936.96		
WALT DISNEY CO/THE	126,988	98.010	12,446,093.88		
WARNER BROS DISCOVERY INC	165,916	12.810	2,125,383.96		
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	15,382	21.230	326,559.86		
CBRE GROUP INC - A	20,793	70.480	1,465,490.64		
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	79,100	4.380	346,458.00		
ZILLOW GROUP INC - C	10,672	43.520	464,445.44		
アメリカ・ドル小計	23,371,031		2,425,112,411.53 (324,480,040,663)		
カナダ・ドル	ARC RESOURCES LTD	44,923	16.530	742,577.19	
	CAMECO CORP	33,586	35.590	1,195,325.74	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	77,007	80.560	6,203,683.92	
	CENOVUS ENERGY INC	99,824	23.180	2,313,920.32	
	ENBRIDGE INC	140,420	53.490	7,511,065.80	
	IMPERIAL OIL LTD	16,267	70.490	1,146,660.83	
	KEYERA CORP	19,802	31.910	631,881.82	
	PARKLAND CORP	7,666	30.890	236,802.74	
	PEMBINA PIPELINE CORP	37,348	44.280	1,653,769.44	
	SUNCOR ENERGY INC	91,066	40.710	3,707,296.86	
	TC ENERGY CORP	68,290	55.510	3,790,777.90	
	TOURMALINE OIL CORP	20,401	60.430	1,232,832.43	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	31,873	76.800	2,447,846.40	
BARRICK GOLD CORP	114,792	26.140	3,000,662.88		

CCL INDUSTRIES INC - CL B	8,705	64.360	560,253.80	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	41,452	31.170	1,292,058.84	
FRANCO-NEVADA CORP	12,789	208.310	2,664,076.59	
IVANHOE MINES LTD-CL A	32,698	11.850	387,471.30	
KINROSS GOLD CORP	110,156	6.840	753,467.04	
LUNDIN MINING CORP	46,446	10.240	475,607.04	
NUTRIEN LTD	36,792	94.770	3,486,777.84	
PAN AMERICAN SILVER CORP	25,157	23.400	588,673.80	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	34,947	58.960	2,060,475.12	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,438	99.180	440,160.84	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	31,091	67.570	2,100,818.87	
CAE INC	17,963	30.730	552,002.99	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	6,027	108.670	654,954.09	
WSP GLOBAL INC	9,260	178.290	1,650,965.40	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	9,913	46.810	464,027.53	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	12,520	77.210	966,669.20	
THOMSON REUTERS CORP	11,370	179.030	2,035,571.10	
AIR CANADA	12,083	18.470	223,173.01	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	40,874	161.630	6,606,464.62	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	65,344	108.120	7,064,993.28	
TFI INTERNATIONAL INC	5,097	156.830	799,362.51	
MAGNA INTERNATIONAL INC	18,921	70.930	1,342,066.53	
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,082	100.850	310,819.70	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	11,302	43.020	486,212.04	
RESTAURANT BRANDS INTERN	19,270	94.020	1,811,765.40	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	3,001	180.590	541,950.59	
DOLLARAMA INC	20,468	84.480	1,729,136.64	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	57,969	66.580	3,859,576.02	
EMPIRE CO LTD 'A'	9,148	36.550	334,359.40	
LOBLAW COMPANIES LTD	11,573	125.730	1,455,073.29	
METRO INC/CN	14,765	76.820	1,134,247.30	
WESTON (GEORGE) LTD	4,984	179.950	896,870.80	
SAPUTO INC	18,270	34.920	637,988.40	
BANK OF MONTREAL	47,679	120.720	5,755,808.88	
BANK OF NOVA SCOTIA	83,370	66.410	5,536,601.70	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	64,792	55.510	3,596,603.92	
NATIONAL BANK OF CANADA	22,533	97.960	2,207,332.68	
ROYAL BANK OF CANADA	94,772	131.760	12,487,158.72	
TORONTO-DOMINION BANK	124,589	81.120	10,106,659.68	
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	23,555	44.300	1,043,486.50	
BROOKFIELD CORP	94,219	43.300	4,079,682.70	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	32,674	17.010	555,784.74	
IGM FINANCIAL INC	4,949	40.800	201,919.20	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	5,042	54.620	275,394.04	

ONEX CORPORATION	4,217	62.530	263,689.01		
TMX GROUP LTD	3,142	137.970	433,501.74		
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,393	924.000	1,287,132.00		
GREAT-WEST LIFECO INC	22,964	37.880	869,876.32		
IA FINANCIAL CORP INC	8,268	86.650	716,422.20		
INTACT FINANCIAL CORP	11,416	203.880	2,327,494.08		
MANULIFE FINANCIAL CORP	134,995	25.840	3,488,270.80		
POWER CORP OF CANADA	41,436	35.680	1,478,436.48		
SUN LIFE FINANCIAL INC	41,957	65.120	2,732,239.84		
CGI INC	15,720	132.790	2,087,458.80		
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,338	2,634.980	3,525,603.24		
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,424	106.280	682,742.72		
OPEN TEXT CORP	21,507	50.580	1,087,824.06		
SHOPIFY INC - CLASS A	80,264	63.340	5,083,921.76		
BCE INC	5,509	64.680	356,322.12		
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	25,321	64.640	1,636,749.44		
TELUS CORP	15,222	28.510	433,979.22		
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	44,154	11.480	506,887.92		
ALTAGAS LTD	17,347	23.140	401,409.58		
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	6,336	45.880	290,695.68		
CANADIAN UTILITIES LTD-A	7,344	39.670	291,336.48		
EMERA INC	18,000	58.820	1,058,760.00		
FORTIS INC	35,086	60.070	2,107,616.02		
HYDRO ONE LTD	24,747	40.430	1,000,521.21		
NORTHLAND POWER INC	15,741	34.100	536,768.10		
QUEBECOR INC -CL B	14,578	34.290	499,879.62		
FIRSTSERVICE CORP	2,516	195.030	490,695.48		
カナダ・ドル小計	2,796,256		167,705,861.87 (16,467,038,577)		
オーストラ リア・ドル	AMPOL LTD	19,016	30.440	578,847.04	
	SANTOS LTD	213,811	7.100	1,518,058.10	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	12,722	31.580	401,760.76	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	132,981	33.540	4,460,182.74	
	BHP GROUP LTD	353,155	44.170	15,598,856.35	
	BLUESCOPE STEEL LTD	37,214	20.640	768,096.96	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	121,817	20.760	2,528,920.92	
	IGO LTD	54,323	13.970	758,892.31	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	26,108	33.200	866,785.60	
	MINERAL RESOURCES LTD	11,662	80.360	937,158.32	
	NEWCREST MINING LTD	54,082	28.630	1,548,367.66	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	65,844	13.590	894,819.96	
	ORICA LTD	36,212	16.150	584,823.80	
	PILBARA MINERALS LTD	197,160	4.230	833,986.80	
	RIO TINTO LTD	25,693	113.180	2,907,933.74	

SOUTH32 LTD	276,348	4.120	1,138,553.76	
REECE LTD	13,059	18.170	237,282.03	
BRAMBLES LTD	105,161	14.180	1,491,182.98	
COMPUTERSHARE LTD	38,485	22.860	879,767.10	
AURIZON HOLDINGS LTD	130,251	3.490	454,575.99	
QANTAS AIRWAYS LTD	78,226	6.610	517,073.86	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	43,243	37.970	1,641,936.71	
IDP EDUCATION LTD	15,855	28.810	456,782.55	
LOTTERY CORP LTD/THE	139,785	5.040	704,516.40	
WESFARMERS LTD	78,698	52.390	4,122,988.22	
COLES GROUP LTD	91,859	18.340	1,684,694.06	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	106,589	6.870	732,266.43	
WOOLWORTHS GROUP LTD	83,181	39.000	3,244,059.00	
TREASURY WINE ESTATES LTD	45,684	14.040	641,403.36	
COCHLEAR LTD	4,095	251.540	1,030,056.30	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	14,565	66.750	972,213.75	
SONIC HEALTHCARE LTD	31,126	36.370	1,132,052.62	
CSL LTD	33,279	304.340	10,128,130.86	
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	209,348	24.220	5,070,408.56	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	117,061	100.110	11,718,976.71	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	220,259	28.790	6,341,256.61	
WESTPAC BANKING CORP	244,569	22.250	5,441,660.25	
ASX LTD	11,180	69.100	772,538.00	
MACQUARIE GROUP LTD	26,074	181.450	4,731,127.30	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	173,755	4.960	861,824.80	
MEDIBANK PRIVATE LTD	128,724	3.590	462,119.16	
QBE INSURANCE GROUP LTD	101,860	15.130	1,541,141.80	
SUNCORP GROUP LTD	88,234	12.400	1,094,101.60	
WISETECH GLOBAL LTD	10,621	69.380	736,884.98	
XERO LTD	8,683	92.370	802,048.71	
TELSTRA GROUP LTD	273,343	4.300	1,175,374.90	
ORIGIN ENERGY LTD	134,865	8.350	1,126,122.75	
REA GROUP LTD	2,833	140.020	396,676.66	
SEEK LTD	21,957	24.340	534,433.38	
オーストラリア・ドル小計	4,464,655		109,203,723.21 (9,687,462,286)	
香港・ドル				
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	173,424	50.900	8,827,281.60	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	101,000	79.700	8,049,700.00	
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	94,000	14.060	1,321,640.00	
MTR CORP	118,500	38.150	4,520,775.00	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	70,000	17.260	1,208,200.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	149,000	54.900	8,180,100.00	
SANDS CHINA LTD	142,400	27.800	3,958,720.00	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	147,000	22.300	3,278,100.00	

	WH GROUP LTD	561,000	4.450	2,496,450.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	247,000	24.600	6,076,200.00	
	HANG SENG BANK LTD	48,200	113.300	5,461,060.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	83,600	325.000	27,170,000.00	
	AIA GROUP LTD	819,000	82.750	67,772,250.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	41,000	43.650	1,789,650.00	
	CLP HOLDINGS LTD	119,600	57.550	6,882,980.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	722,389	6.850	4,948,364.65	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	91,500	43.500	3,980,250.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	126,924	45.450	5,768,695.80	
	ESR GROUP LTD	157,000	12.320	1,934,240.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	190,000	14.080	2,675,200.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	83,384	26.700	2,226,352.80	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	84,833	19.920	1,689,873.36	
	SINO LAND CO	248,200	10.400	2,581,280.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	95,500	106.400	10,161,200.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	27,000	57.550	1,553,850.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	116,800	20.150	2,353,520.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	125,000	43.050	5,381,250.00	
	香港・ドル小計	4,983,254		202,247,183.21 (3,446,292,002)	
シンガポール・ドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	10,800	33.330	359,964.00	
	KEPPEL CORP LTD	94,400	6.350	599,440.00	
	SEBACORP MARINE LTD	1,801,627	0.120	216,195.24	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	108,600	3.600	390,960.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	113,566	5.820	660,954.12	
	GENTING SINGAPORE LTD	452,500	1.150	520,375.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	130,000	4.090	531,700.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	125,800	32.910	4,140,078.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	230,600	12.620	2,910,172.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	82,900	29.400	2,437,260.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	65,200	9.600	625,920.00	
	VENTURE CORP LTD	21,700	17.370	376,929.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	579,015	2.460	1,424,376.90	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	176,200	3.860	680,132.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	25,800	7.370	190,146.00	
UOL GROUP LTD	30,900	7.150	220,935.00		
	シンガポール・ドル小計	4,049,608		16,285,537.26 (1,628,716,581)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	78,808	8.750	689,570.00	
	EBOS GROUP LTD	12,387	45.700	566,085.90	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	39,017	27.550	1,074,918.35	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	145,482	5.115	744,140.43	
	MERCURY NZ LTD	38,935	6.260	243,733.10	

	MERIDIAN ENERGY LTD	91,327	5.400	493,165.80	
	ニュージーランド・ドル小計	405,956		3,811,613.58 (313,276,520)	
イギリス・ ポンド	BP PLC	1,254,059	5.293	6,637,734.28	
	SHELL PLC	487,724	24.255	11,829,745.62	
	ANGLO AMERICAN PLC	85,329	24.260	2,070,081.54	
	ANTOFAGASTA PLC	30,983	14.780	457,928.74	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,296	70.580	726,691.68	
	GLENCORE PLC	728,838	4.690	3,418,250.22	
	JOHNSON MATTHEY PLC	10,074	19.210	193,521.54	
	MONDI PLC	33,905	12.590	426,863.95	
	RIO TINTO PLC	76,572	49.845	3,816,731.34	
	ASHTED GROUP PLC	30,439	46.490	1,415,109.11	
	BAE SYSTEMS PLC	209,260	10.320	2,159,563.20	
	BUNZL PLC	22,658	32.020	725,509.16	
	DCC PLC	5,954	48.560	289,126.24	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	649,146	1.529	992,544.23	
	SMITHS GROUP PLC	24,369	16.755	408,302.59	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	4,459	115.300	514,122.70	
	EXPERIAN PLC	63,031	27.920	1,759,825.52	
	INTERTEK GROUP PLC	11,884	41.330	491,165.72	
	RELX PLC	133,993	27.100	3,631,210.30	
	RENTOKIL INITIAL PLC	156,848	6.110	958,341.28	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,766	4.807	311,330.16	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,637	43.520	288,842.24	
	BURBERRY GROUP PLC	26,233	26.410	692,813.53	
	PERSIMMON PLC	27,665	12.360	341,939.40	
	TAYLOR WIMPEY PLC	225,588	1.211	273,187.06	
	COMPASS GROUP PLC	120,046	20.920	2,511,362.32	
	ENTAIN PLC	42,158	14.390	606,653.62	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	11,820	55.560	656,719.20	
	PEARSON PLC	46,942	8.512	399,570.30	
	WHITBREAD PLC	16,522	32.590	538,451.98	
	JD SPORTS FASHION PLC	144,300	1.660	239,538.00	
	KINGFISHER PLC	109,678	2.555	280,227.29	
NEXT PLC	9,030	67.760	611,872.80		
OCADO GROUP PLC	27,379	5.072	138,866.28		
SAINSBURY (J) PLC	113,480	2.805	318,311.40		
TESCO PLC	495,919	2.783	1,380,142.57		
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	24,258	19.840	481,278.72		
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	148,021	29.720	4,399,184.12		
COCA-COLA HBC AG-DI	17,866	24.380	435,573.08		
DIAGEO PLC	157,411	37.770	5,945,413.47		
IMPERIAL BRANDS PLC	59,422	19.895	1,182,200.69		

HALEON PLC	360,325	3.500	1,261,137.50		
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	49,582	65.000	3,222,830.00		
UNILEVER PLC	175,349	44.160	7,743,411.84		
NMC HEALTH PLC	3,940	0.010	39.40		
SMITH & NEPHEW PLC	57,278	12.740	729,721.72		
ASTRAZENECA PLC	107,738	122.940	13,245,309.72		
GSK PLC	280,453	15.002	4,207,355.90		
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	14,590	18.205	265,610.95		
BARCLAYS PLC	1,083,154	1.514	1,639,895.15		
HSBC HOLDINGS PLC	1,365,566	5.663	7,733,200.25		
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,801,858	0.482	2,314,495.55		
NATWEST GROUP PLC	347,420	2.676	929,695.92		
STANDARD CHARTERED PLC	182,397	6.206	1,131,955.78		
3I GROUP PLC	70,572	17.325	1,222,659.90		
ABRDN PLC	138,015	2.065	285,000.97		
HARGREAVES LANSDOWN PLC	31,008	7.998	248,001.98		
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	25,978	80.920	2,102,139.76		
M&G PLC	119,733	1.997	239,106.80		
SCHRODERS PLC	61,711	4.830	298,064.13		
ST JAMES'S PLACE PLC	33,823	12.440	420,758.12		
ADMIRAL GROUP PLC	11,535	22.590	260,575.65		
AVIVA PLC	174,060	4.193	729,833.58		
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	386,391	2.514	971,386.97		
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	59,286	5.760	341,487.36		
PRUDENTIAL PLC	193,423	11.300	2,185,679.90		
SAGE GROUP PLC/THE	75,045	8.052	604,262.34		
HALMA PLC	24,375	22.870	557,456.25		
BT GROUP PLC	540,623	1.534	829,315.68		
VODAFONE GROUP PLC	1,775,294	0.912	1,619,068.12		
NATIONAL GRID PLC	260,873	11.535	3,009,170.05		
SEVERN TRENT PLC	20,117	29.560	594,658.52		
SSE PLC	70,532	18.460	1,302,020.72		
UNITED UTILITIES GROUP PLC	42,035	10.915	458,812.02		
AUTO TRADER GROUP PLC	51,319	6.322	324,438.71		
INFORMA PLC	102,755	7.152	734,903.76		
WPP PLC	78,503	9.470	743,423.41		
イギリス・ボンド小計	19,101,618		129,462,731.57 (21,488,224,186)		
イスラエル・シケル	ICL GROUP LTD	41,773	22.630	945,322.99	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,389	651.100	904,377.90	
	BANK HAPOALIM BM	84,682	30.070	2,546,387.74	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	115,937	27.670	3,207,976.79	
	FIRST INTL BANK ISRAEL	2,252	129.400	291,408.80	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	85,339	17.350	1,480,631.65	

	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	9,249	115.900	1,071,959.10	
	NICE LTD	3,919	762.600	2,988,629.40	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	7,438	164.500	1,223,551.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	179,569	4.870	874,501.03	
	AZRIELI GROUP LTD	3,527	208.000	733,616.00	
	イスラエル・シュケル小計	535,074		16,268,362.40 (596,933,396)	
スイス・フ ラン	CLARIANT AG-REG	10,101	14.590	147,373.59	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	538	790.000	425,020.00	
	GIVAUDAN-REG	605	3,168.000	1,916,640.00	
	HOLCIM LTD	39,459	59.380	2,343,075.42	
	SIG GROUP AG	22,269	24.080	536,237.52	
	SIKA AG-REG	9,946	242.200	2,408,921.20	
	ABB LTD-REG	109,550	32.780	3,591,049.00	
	GEBERIT AG-REG	2,322	489.300	1,136,154.60	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,766	189.900	335,363.40	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,030	197.200	597,516.00	
	VAT GROUP AG	2,164	306.200	662,616.80	
	ADECCO GROUP AG-REG	9,118	29.700	270,804.60	
	SGS SA-REG	11,450	81.380	931,801.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	3,570	260.400	929,628.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	36,108	150.400	5,430,643.20	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,716	310.200	532,303.20	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	5,225	57.300	299,392.50	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	216	1,901.000	410,616.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	72	11,140.000	802,080.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	111,400.000	891,200.00	
	NESTLE SA-REG	190,037	115.520	21,953,074.24	
	ALCON INC	35,956	64.680	2,325,634.08	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,269	285.600	933,626.40	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	7,044	136.000	957,984.00	
	BACHEM HOLDING AG	1,756	95.450	167,610.20	
	LONZA GROUP AG-REG	5,251	556.800	2,923,756.80	
	NOVARTIS AG-REG	148,488	93.120	13,827,202.56	
	ROCHE HOLDING AG-BR	1,740	305.400	531,396.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	48,896	281.900	13,783,782.40	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	3,006	93.550	281,211.30	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	241,102	0.785	189,265.07	
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,168	63.920	969,538.56	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,585	847.600	1,343,446.00		
UBS GROUP AG-REG	231,389	17.800	4,118,724.20		
BALOISE HOLDING AG - REG	2,475	148.700	368,032.50		
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,272	588.000	1,335,936.00		
SWISS RE AG	20,843	89.100	1,857,111.30		

	ZURICH INSURANCE GROUP AG	10,454	429.000	4,484,766.00	
	TEMENOS AG - REG	3,743	63.140	236,333.02	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	13,555	50.360	682,629.80	
	SWISSCOM AG-REG	1,709	605.600	1,034,970.40	
	BKW AG	1,385	154.000	213,290.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,572	79.500	442,974.00	
	スイス・フラン小計	1,265,928		99,560,730.86 (14,929,131,592)	
デンマーク・クローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	7,211	553.400	3,990,567.40	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	14,003	368.200	5,155,904.60	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	513	1,570.500	805,666.50	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	72,299	184.960	13,372,423.04	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	206	12,220.000	2,517,320.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	311	12,360.000	3,843,960.00	
	DSV A/S	12,792	1,234.000	15,785,328.00	
	PANDORA A/S	5,888	636.600	3,748,300.80	
	CARLSBERG AS-B	6,611	1,125.000	7,437,375.00	
	COLOPLAST-B	8,316	964.000	8,016,624.00	
	DEMANT A/S	8,178	285.200	2,332,365.60	
	GENMAB A/S	4,315	2,825.000	12,189,875.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	115,103	1,154.600	132,897,923.80	
	DANSKE BANK A/S	50,000	145.450	7,272,500.00	
TRYG A/S	24,975	158.800	3,966,030.00		
ORSTED A/S	13,257	598.200	7,930,337.40		
	デンマーク・クローネ小計	343,978		231,262,501.14 (4,553,558,647)	
ノルウェー・クローネ	AKER BP ASA	21,204	250.200	5,305,240.80	
	EQUINOR ASA	66,633	301.900	20,116,502.70	
	NORSK HYDRO ASA	87,753	78.140	6,857,019.42	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,718	443.400	5,639,161.20	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	6,526	469.800	3,065,914.80	
	MOWI ASA	30,723	198.700	6,104,660.10	
	ORKLA ASA	46,955	75.320	3,536,650.60	
	SALMAR ASA	4,188	459.800	1,925,642.40	
	DNB BANK ASA	61,691	199.950	12,335,115.45	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	11,412	181.100	2,066,713.20	
	TELENOR ASA	48,435	129.900	6,291,706.50	
ADEVINTA ASA	15,540	79.700	1,238,538.00		
	ノルウェー・クローネ小計	413,778		74,482,865.17 (932,525,472)	
スウェーデン・クローナ	BOLIDEN AB	20,658	366.600	7,573,222.80	
	HOLMEN AB-B SHARES	7,024	372.300	2,615,035.20	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	34,370	129.150	4,438,885.50	
	ALFA LAVAL AB	18,697	382.300	7,147,863.10	
	ASSA ABLOY AB-B	72,539	241.100	17,489,152.90	

ATLAS COPCO AB-A SHS	185,739	130.450	24,229,652.55	
ATLAS COPCO AB-B SHS	107,424	117.900	12,665,289.60	
EPIROC AB-A	44,746	211.000	9,441,406.00	
EPIROC AB-B	33,182	181.700	6,029,169.40	
HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	86.760	1,613,128.68	
INDUTRADE AB	17,913	226.100	4,050,129.30	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,223	208.600	1,715,317.80	
LIFCO AB-B SHS	15,149	231.300	3,503,963.70	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	109,274	119.400	13,047,315.60	
SANDVIK AB	70,108	214.500	15,038,166.00	
SKANSKA AB-B SHS	26,915	161.900	4,357,538.50	
SKF AB-B SHARES	31,715	194.350	6,163,810.25	
VOLVO AB-A SHS	13,283	218.400	2,901,007.20	
VOLVO AB-B SHS	101,613	211.550	21,496,230.15	
SECURITAS AB-B SHS	41,010	90.760	3,722,067.60	
VOLVO CAR AB-B	38,628	39.460	1,524,260.88	
ELECTROLUX AB-B	11,555	135.800	1,569,169.00	
EVOLUTION AB	13,101	1,404.600	18,401,664.60	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	52,210	152.940	7,984,997.40	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	45,427	307.500	13,968,802.50	
GETINGE AB-B SHS	13,151	264.800	3,482,384.80	
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	13,513	263.000	3,553,919.00	
NORDEA BANK ABP	229,567	116.780	26,808,834.26	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	108,374	114.250	12,381,729.50	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	97,603	95.160	9,287,901.48	
SWEDBANK AB - A SHARES	63,538	183.500	11,659,223.00	
EQT AB	23,194	210.400	4,880,017.60	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	7,211	291.100	2,099,122.10	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,642	290.900	3,095,757.80	
INVESTOR AB-A SHS	37,586	223.900	8,415,505.40	
INVESTOR AB-B SHS	131,141	218.800	28,693,650.80	
KINNEVIK AB - B	12,465	165.400	2,061,711.00	
LUNDBERGS AB-B SHS	6,081	482.600	2,934,690.60	
ERICSSON LM-B SHS	183,318	54.810	10,047,659.58	
HEXAGON AB-B SHS	135,861	116.750	15,861,771.75	
TELE2 AB-B SHS	38,424	104.550	4,017,229.20	
TELIA CO AB	187,675	26.620	4,995,908.50	
EMBRACER GROUP AB	30,012	49.225	1,477,340.70	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	31,938	46.200	1,475,535.60	
SAGAX AB-B	14,721	243.500	3,584,563.50	
スウェーデン・クローナ小計	2,515,111		373,501,702.38 (4,848,052,097)	
ユーロ	ENI SPA	175,361	13.614	2,387,364.65
	GALP ENERGIA SGPS SA	32,353	10.810	349,735.93

NESTE OYJ	28,878	43.900	1,267,744.20	
OMV AG	10,043	42.570	427,530.51	
REPSOL SA	96,457	13.600	1,311,815.20	
TENARIS SA	31,142	12.955	403,444.61	
TOTALENERGIES SE	171,943	57.650	9,912,513.95	
AIR LIQUIDE SA	35,636	163.280	5,818,646.08	
AKZO NOBEL N.V.	12,475	74.760	932,631.00	
ARCELORMITTAL	37,054	25.025	927,276.35	
ARKEMA	5,145	87.700	451,216.50	
BASF SE	64,323	50.160	3,226,441.68	
COVESTRO AG	11,797	36.430	429,764.71	
CRH PLC	49,499	45.550	2,254,679.45	
DSM-FIRMENICH AG	12,077	119.800	1,446,824.60	
EVONIK INDUSTRIES AG	17,669	19.460	343,838.74	
HEIDELBERGCEMENT AG	10,008	69.300	693,554.40	
OCI NV	6,000	24.420	146,520.00	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	17,189	32.680	561,736.52	
SOLVAY SA	4,802	108.900	522,937.80	
STORA ENSO OYJ-R SHS	39,228	11.150	437,392.20	
SYMRISE AG	9,721	107.900	1,048,895.90	
UMICORE	16,912	29.070	491,631.84	
UPM-KYMMENE OYJ	38,447	29.390	1,129,957.33	
VOESTALPINE AG	7,613	30.680	233,566.84	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	13,416	31.370	420,859.92	
AIRBUS SE	40,988	125.900	5,160,389.20	
ALSTOM	25,574	22.110	565,441.14	
BOUYGUES SA	17,123	32.020	548,278.46	
BRENTAG SE	9,920	74.740	741,420.80	
CNH INDUSTRIAL NV	68,766	12.675	871,609.05	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	34,454	50.680	1,746,128.72	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	29,358	30.830	905,107.14	
DASSAULT AVIATION SA	1,720	176.000	302,720.00	
EIFFAGE	4,989	105.550	526,588.95	
FERROVIAL SA	32,177	28.240	908,678.48	
GEA GROUP AG	10,467	43.190	452,069.73	
IMCD NV	3,214	143.600	461,530.40	
KINGSPAN GROUP PLC	11,262	59.620	671,440.44	
KNORR-BREMSE AG	3,881	62.180	241,320.58	
KONE OYJ-B	24,225	49.050	1,188,236.25	
LEGRAND SA	19,539	85.380	1,668,239.82	
METSO OUTOTEC OYJ	50,483	10.330	521,489.39	
MTU AERO ENGINES AG	3,854	239.400	922,647.60	
PRYSMIAN SPA	17,186	37.160	638,631.76	
RATIONAL AG	350	655.500	229,425.00	

RHEINMETALL AG	2,899	277.100	803,312.90	
SAFRAN SA	23,990	142.060	3,408,019.40	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	37,574	155.920	5,858,538.08	
SIEMENS AG-REG	52,620	147.380	7,755,135.60	
SIEMENS ENERGY AG	31,878	21.130	673,582.14	
THALES SA	7,074	140.500	993,897.00	
VINCI SA	36,202	108.700	3,935,157.40	
WARTSILA OYJ ABP	26,753	10.095	270,071.53	
BUREAU VERITAS SA	17,817	26.210	466,983.57	
RANDSTAD NV	8,946	48.390	432,896.94	
TELEPERFORMANCE	4,299	203.700	875,706.30	
WOLTERS KLUWER	18,802	122.000	2,293,844.00	
ADP	1,346	137.800	185,478.80	
AENA SME SA	5,640	154.000	868,560.00	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	50,885	9.685	492,821.22	
DEUTSCHE POST AG-REG	69,811	42.585	2,972,901.43	
GETLINK SE	30,428	16.610	505,409.08	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	22,804	101.440	2,313,237.76	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	3,679	95.400	350,976.60	
CONTINENTAL AG	8,078	64.420	520,384.76	
DR ING HC F PORSCHE AG	7,000	114.750	803,250.00	
FERRARI NV	8,992	254.300	2,286,665.60	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	55,881	69.760	3,898,258.56	
MICHELIN (CGDE)	45,659	27.910	1,274,342.69	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	10,089	50.080	505,257.12	
RENAULT SA	14,764	33.110	488,836.04	
STELLANTIS NV	149,423	14.754	2,204,586.94	
VALEO	14,444	18.030	260,425.32	
VOLKSWAGEN AG	1,960	148.500	291,060.00	
VOLKSWAGEN AG-PREF	11,844	120.740	1,430,044.56	
ADIDAS AG	12,090	160.100	1,935,609.00	
HERMES INTERNATIONAL	2,137	1,992.600	4,258,186.20	
KERING	5,266	585.200	3,081,663.20	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	19,127	889.400	17,011,553.80	
MONCLER SPA	15,710	67.540	1,061,053.40	
PUMA SE	6,459	57.100	368,808.90	
SEB SA	1,127	100.500	113,263.50	
ACCOR SA	10,451	31.630	330,565.13	
AMADEUS IT GROUP SA	29,928	62.900	1,882,471.20	
DELIVERY HERO SE	13,293	33.470	444,916.71	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	12,030	180.650	2,173,219.50	
JUST EAT TAKEAWAY	12,903	15.202	196,151.40	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,785	38.800	224,458.00	
SODEXO SA	6,960	97.740	680,270.40	

D'IETEREN GROUP	1,858	170.200	316,231.60	
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL	78,719	31.380	2,470,202.22	
PROSUS NV	55,136	66.190	3,649,451.84	
ZALANDO SE	17,418	35.830	624,086.94	
CARREFOUR SA	35,990	18.440	663,655.60	
HELLOFRESH SE	9,790	25.030	245,043.70	
JERONIMO MARTINS	21,241	21.800	463,053.80	
KESKO OYJ-B SHS	20,250	20.570	416,542.50	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	71,069	31.620	2,247,201.78	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	60,855	60.080	3,656,168.40	
DANONE	45,570	60.440	2,754,250.80	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	35,407	11.885	420,812.19	
HEINEKEN HOLDING NV	7,962	87.000	692,694.00	
HEINEKEN NV	18,666	104.650	1,953,396.90	
JDE PEET'S NV	6,660	27.780	185,014.80	
KERRY GROUP PLC-A	9,894	99.280	982,276.32	
PERNOD RICARD SA	14,736	217.400	3,203,606.40	
REMY COINTREAU	1,273	179.050	227,930.65	
BEIERSDORF AG	6,813	125.300	853,668.90	
HENKEL AG & CO KGAA	5,974	66.420	396,793.08	
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	13,009	72.700	945,754.30	
L'OREAL	16,700	432.400	7,221,080.00	
AMPLIFON SPA	7,567	33.040	250,013.68	
BIOMERIEUX	2,791	95.820	267,433.62	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2,161	123.350	266,559.35	
DIASORIN SPA	1,313	97.520	128,043.76	
ESSILORLUXOTTICA	19,585	184.840	3,620,091.40	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	13,613	42.540	579,097.02	
FRESENIUS SE & CO KGAA	31,227	25.590	799,098.93	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	61,140	19.332	1,181,958.48	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	19,203	56.660	1,088,041.98	
ARGENX SE	3,754	358.400	1,345,433.60	
BAYER AG-REG	68,041	60.430	4,111,717.63	
EUROFINS SCIENTIFIC	9,270	60.440	560,278.80	
GRIFOLS SA	15,169	9.128	138,462.63	
IPSEN	3,380	108.000	365,040.00	
MERCK KGAA	8,996	161.550	1,453,303.80	
ORION OYJ-CLASS B	6,261	47.040	294,517.44	
QIAGEN N.V.	15,665	40.610	636,155.65	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	8,068	40.700	328,367.60	
SANOFI	78,739	104.620	8,237,674.18	
SARTORIUS AG-VORZUG	1,682	349.900	588,531.80	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,207	241.400	532,769.80	
UCB SA	8,758	87.940	770,178.52	

ABN AMRO BANK NV-CVA	28,787	14.300	411,654.10	
AIB GROUP PLC	70,110	3.920	274,831.20	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	420,232	6.648	2,793,702.33	
BANCO SANTANDER SA	1,160,000	3.330	3,862,800.00	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	75,242	9.694	729,395.94	
BNP PARIBAS	77,135	57.730	4,453,003.55	
CAIXABANK SA	290,777	3.494	1,015,974.83	
COMMERZBANK AG	73,561	10.335	760,252.93	
CREDIT AGRICOLE SA	90,899	10.812	982,799.98	
ERSTE GROUP BANK AG	24,737	32.400	801,478.80	
FINECOBANK SPA	43,093	13.920	599,854.56	
ING GROEP NV	254,105	11.500	2,922,207.50	
INTESA SANPAOLO	1,163,000	2.461	2,862,143.00	
KBC GROUP NV	17,643	64.820	1,143,619.26	
MEDIOBANCA SPA	47,708	9.732	464,294.25	
SOCIETE GENERALE SA	55,196	21.590	1,191,681.64	
UNICREDIT SPA	127,961	18.354	2,348,596.19	
ADYEN NV	1,553	1,426.400	2,215,199.20	
AMUNDI SA	3,955	58.750	232,356.25	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	146,020	9.518	1,389,818.36	
DEUTSCHE BOERSE AG	12,983	186.300	2,418,732.90	
EDENRED	16,785	58.400	980,244.00	
EURAZEO SE	1,792	65.750	117,824.00	
EURONEXT NV	5,502	72.450	398,619.90	
EXOR NV	8,669	74.660	647,227.54	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	6,879	80.280	552,246.12	
NEXI SPA	30,853	7.542	232,693.32	
SOFINA	804	207.000	166,428.00	
WENDEL	1,082	100.700	108,957.40	
WORLDLINE SA	16,677	38.190	636,894.63	
AEGON NV	127,748	4.063	519,040.12	
AGEAS	11,247	40.230	452,466.81	
ALLIANZ SE-REG	28,239	224.100	6,328,359.90	
ASSICURAZIONI GENERALI	72,382	18.990	1,374,534.18	
AXA SA	132,535	29.285	3,881,287.47	
HANNOVER RUECK SE	3,598	190.800	686,498.40	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	9,828	337.600	3,317,932.80	
NN GROUP NV	16,917	33.680	569,764.56	
POSTE ITALIANE SPA	34,720	9.488	329,423.36	
SAMPO OYJ-A SHS	33,064	45.390	1,500,774.96	
BECHTLE AG	4,305	40.920	176,160.60	
CAPGEMINI SE	11,555	160.900	1,859,199.50	
DASSAULT SYSTEMES SE	46,266	37.440	1,732,199.04	
NEMETSCHEK SE	3,011	63.480	191,138.28	

SAP SE	71,964	122.580	8,821,347.12	
NOKIA OYJ	379,853	3.793	1,440,782.42	
ASM INTERNATIONAL NV	3,170	344.700	1,092,699.00	
ASML HOLDING NV	27,834	563.800	15,692,809.20	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	93,057	33.835	3,148,583.59	
STMICROELECTRONICS NV	48,663	41.885	2,038,249.75	
CELLNEX TELECOM SA	41,167	37.780	1,555,289.26	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	225,304	22.230	5,008,507.92	
ELISA OYJ	10,160	55.860	567,537.60	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	28,190	12.415	349,978.85	
KONINKLIJKE KPN NV	222,179	3.239	719,637.78	
ORANGE	127,798	11.436	1,461,497.92	
TELECOM ITALIA SPA	696,355	0.259	180,355.94	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	79,654	3.011	239,838.19	
TELEFONICA SA	357,425	3.971	1,419,334.67	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,269	15.340	80,826.46	
ACCIONA SA	1,810	173.200	313,492.00	
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	4,317	33.120	142,979.04	
E.ON SE	164,322	11.900	1,955,431.80	
EDP RENOVAVEIS SA	17,764	20.120	357,411.68	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	195,232	5.166	1,008,568.51	
ELIA GROUP SA/NV	2,111	122.800	259,230.80	
ENAGAS SA	14,471	17.555	254,038.40	
ENDESA SA	25,535	19.810	505,848.35	
ENEL SPA	566,643	6.056	3,431,590.00	
ENGIE	117,899	15.426	1,818,709.97	
FORTUM OYJ	24,312	13.430	326,510.16	
IBERDROLA SA	427,172	11.830	5,053,444.76	
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,603	28.260	299,640.78	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	23,632	16.380	387,092.16	
RWE AG	44,264	41.570	1,840,054.48	
SNAM SPA	133,867	4.979	666,523.79	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA	101,686	7.768	789,896.84	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	48,732	28.840	1,405,430.88	
VERBUND AG	4,503	82.250	370,371.75	
BOLLORE SE	69,288	6.065	420,231.72	
PUBLICIS GROUPE	15,558	74.560	1,160,004.48	
SCOUT24 SE	4,671	55.860	260,922.06	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	49,395	21.020	1,038,282.90	
VIVENDI SE	57,161	9.610	549,317.21	
AROUNDTOWN SA	73,508	1.175	86,371.90	
LEG IMMOBILIEN SE	4,538	53.520	242,873.76	
VONOVIA SE	52,313	18.575	971,713.97	
ユーロ小計	12,725,649		332,531,003.37	

			(48,805,575,366)	
合計	76,971,896		452,176,827,385	(452,176,827,385)

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

通貨	銘柄数		組入株式時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	株式	601銘柄	68.7%	71.8%
カナダ・ドル	株式	85銘柄	3.5%	3.6%
オーストラリア・ドル	株式	49銘柄	2.0%	2.1%
香港・ドル	株式	27銘柄	0.7%	0.8%
シンガポール・ドル	株式	16銘柄	0.3%	0.4%
ニュージーランド・ドル	株式	6銘柄	0.1%	0.1%
イギリス・ポンド	株式	77銘柄	4.5%	4.8%
イスラエル・シェケル	株式	11銘柄	0.1%	0.1%
スイス・フラン	株式	43銘柄	3.2%	3.3%
デンマーク・クローネ	株式	16銘柄	1.0%	1.0%
ノルウェー・クローネ	株式	12銘柄	0.2%	0.2%
スウェーデン・クローナ	株式	45銘柄	1.0%	1.1%
ユーロ	株式	221銘柄	10.3%	10.8%

(b)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	11,189.00	1,348,722.06	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	20,093.00	652,821.57	
		AMERICAN TOWER CORP	32,161.00	6,488,160.14	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	35,166.00	667,450.68	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,245.00	1,757,939.55	
		BOSTON PROPERTIES INC	9,604.00	483,081.20	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,861.00	824,304.46	
		CROWN CASTLE INC	30,695.00	3,751,849.85	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	20,462.00	1,997,909.68	
		EQUINIX INC	6,342.00	4,503,263.94	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	11,186.00	760,759.86	
		EQUITY RESIDENTIAL	26,128.00	1,581,266.56	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,379.00	910,262.73	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	9,883.00	1,485,810.22	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	17,613.00	901,433.34	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	22,843.00	439,499.32	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	36,377.00	767,918.47	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	46,189.00	735,328.88	
		INVITATION HOMES INC	44,730.00	1,447,910.10	
		IRON MOUNTAIN INC	19,659.00	1,066,697.34	
KIMCO REALTY CORP	44,824.00	845,380.64			
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	48,792.00	392,287.68			

	MID-AMERICA APARTMENT COMM	7,866.00	1,162,909.44	
	PROLOGIS INC	63,644.00	7,678,012.16	
	PUBLIC STORAGE	11,097.00	3,218,130.00	
	REALTY INCOME CORP	42,018.00	2,606,796.72	
	REGENCY CENTERS CORP	9,608.00	578,497.68	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	7,141.00	1,796,818.42	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	22,292.00	2,434,732.24	
	SUN COMMUNITIES INC	8,247.00	1,144,353.72	
	UDR INC	20,610.00	842,124.60	
	VENTAS INC	28,342.00	1,313,935.12	
	VICI PROPERTIES INC	68,586.00	2,266,767.30	
	WELLTOWER INC	31,795.00	2,428,820.05	
	WEYERHAEUSER CO	54,126.00	1,617,826.14	
	WP CAREY INC	13,861.00	1,020,030.99	
	アメリカ・ドル小計	905,654.00	63,919,812.85 (8,552,470,959)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,170.00	396,163.30	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,441.00	157,079.51	
	カナダ・ドル小計	15,611.00	553,242.81 (54,322,912)	
オーストラリア・ドル	APA GROUP	75,718.00	801,096.44	
	DEXUS/AU	79,604.00	619,319.12	
	GOODMAN GROUP	119,422.00	2,310,815.70	
	GPT GROUP	121,221.00	540,645.66	
	LENLEASE GROUP	36,263.00	273,060.39	
	MIRVAC GROUP	251,619.00	576,207.51	
	SCENTRE GROUP	350,311.00	1,001,889.46	
	STOCKLAND	193,824.00	827,628.48	
	TRANSURBAN GROUP	210,600.00	3,144,258.00	
	VICINITY CENTRES	241,241.00	496,956.46	
	オーストラリア・ドル小計	1,679,823.00	10,591,877.22 (939,605,428)	
香港・ドル	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	276,000.00	2,804,160.00	
	LINK REIT	189,400.00	9,470,000.00	
	香港・ドル小計	465,400.00	12,274,160.00 (209,151,686)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	219,000.00	617,580.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	408,716.00	841,954.96	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	208,100.00	362,094.00	
	MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	112,400.00	200,072.00	
	シンガポール・ドル小計	948,216.00	2,021,700.96 (202,190,313)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	49,008.00	187,896.67	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	59,857.00	385,479.08	
	SEGRO PLC	78,831.00	634,431.88	

	イギリス・ボンド小計	187,696.00	1,207,807.63 (200,471,910)	
ユーロ	COVIVIO	2,388.00	118,444.80	
	GECINA SA	3,082.00	300,803.20	
	KLEPIERRE	13,600.00	295,936.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	8,942.00	433,865.84	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	9,893.00	269,881.04	
	ユーロ小計	37,905.00	1,418,930.88 (208,256,485)	
投資証券合計			10,366,469,694 (10,366,469,694)	
合 計			10,366,469,694 (10,366,469,694)	

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

通貨	銘柄数	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 36銘柄	1.8%	82.5%
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%	9.1%
香港・ドル	投資証券 2銘柄	0.0%	2.0%
シンガポール・ドル	投資証券 4銘柄	0.0%	2.0%
イギリス・ボンド	投資証券 3銘柄	0.0%	1.9%
ユーロ	投資証券 5銘柄	0.0%	2.0%

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。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2022年4月26日現在)	(2023年4月26日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	27,275,290	31,588,157
金銭信託	3,473,575	3,681,111
コール・ローン	175,204,587	165,156,296
国債証券	26,250,030,345	25,666,463,041
派生商品評価勘定	3,271,309	8,236,642
未収入金	2,276,442	-
未収利息	134,293,222	158,452,611
前払費用	33,807,273	38,682,573
流動資産合計	26,629,632,043	26,072,260,431
資産合計	26,629,632,043	26,072,260,431
負債の部		
流動負債		

派生商品評価勘定	707,126,924	279,487,082
未払金	12,354,515	-
未払解約金	1,000,000	10,000,000
その他未払費用	616	362
流動負債合計	720,482,055	289,487,444
負債合計	720,482,055	289,487,444
純資産の部		
元本等		
元本	18,855,361,405	20,379,424,891
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	7,053,788,583	5,403,348,096
元本等合計	25,909,149,988	25,782,772,987
純資産合計	25,909,149,988	25,782,772,987
負債純資産合計	26,629,632,043	26,072,260,431

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2022年4月27日 至 2023年4月26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>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項 目	(2022年4月26日現在)	(2023年4月26日現在)
-----	------------------	------------------

1. 当計算期間の末日における受益権の総数	18,855,361,405口	20,379,424,891口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.3741円 (1万口当たりの純資産額13,741円)	1口当たり純資産額 1.2651円 (1万口当たりの純資産額12,651円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年4月27日 至 2023年4月26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、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年4月26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>
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4月26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	12,764,125,201	-	13,303,120,810	538,995,609
	カナダ・ドル	537,103,222	-	549,889,380	12,786,158
	オーストラリア・ド ル	431,601,589	-	432,161,340	559,751
	シンガポール・ドル	240,762,153	-	248,075,040	7,312,887
	イギリス・ポンド	1,432,825,579	-	1,450,035,200	17,209,621
	イスラエル・シユケ ル	113,572,262	-	115,075,920	1,503,658
	デンマーク・クロー ネ	109,176,944	-	110,431,800	1,254,856
	ノルウェー・クロー ネ	69,538,844	-	70,023,500	484,656
	スウェーデン・ク ローナ	75,018,208	-	75,612,500	594,292
	メキシコ・ペソ	196,132,224	-	201,962,754	5,830,530
	オフショア・人民元	392,885,374	-	396,512,754	3,627,380
	ポーランド・ズロチ	119,218,611	-	120,603,550	1,384,939
	ユーロ	9,924,318,899	-	10,036,630,177	112,311,278
	小計	26,406,279,110	-	27,110,134,725	703,855,615
合 計	26,406,279,110	-	27,110,134,725	703,855,615	

(2023年4月26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	12,625,754,514	-	12,734,784,448	109,029,934
	カナダ・ドル	526,969,746	-	527,376,114	406,368
	オーストラリア・ド ル	407,499,587	-	406,622,133	877,454
	シンガポール・ドル	251,133,939	-	251,642,916	508,977
	ニュージーランド・ ドル	61,330,925	-	60,695,540	635,385
	イギリス・ポンド	1,253,938,634	-	1,267,625,655	13,687,021
	イスラエル・シユケ ル	83,869,197	-	83,508,192	361,005
	デンマーク・クロー ネ	80,788,138	-	82,213,494	1,425,356

	ノルウェー・クローネ	42,291,540	-	41,759,018	532,522
	スウェーデン・クローナ	52,169,348	-	52,887,816	718,468
	メキシコ・ペソ	227,639,418	-	230,295,032	2,655,614
	オフショア・人民元	1,287,571,114	-	1,281,910,140	5,660,974
	ポーランド・ズロチ	118,943,534	-	123,575,672	4,632,138
	ユーロ	8,533,736,703	-	8,679,990,607	146,253,904
	小計	25,553,636,337	-	25,824,886,777	271,250,440
	合 計	25,553,636,337	-	25,824,886,777	271,250,440

(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。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2022年4月27日 至 2023年4月26日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2022年4月26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	13,008,296,854円
同期中における追加設定元本額	12,051,443,547円
同期中における一部解約元本額	6,204,378,996円
2022年4月26日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	3,296,843,012円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,961,569,030円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	794,172,937円
イオン・バランス戦略ファンド	990,054,894円

三井住友・資産最適化ファンド(1 安定重視型)	1,966,334,846円
三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)	743,710,240円
三井住友・資産最適化ファンド(3 バランス型)	1,325,826,094円
三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)	322,764,675円
三井住友・資産最適化ファンド(5 成長重視型)	84,406,317円
三井住友・D CつみたてN I S A・世界分散ファンド	47,175,053円
日興F W S・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)	426,749,820円
S M A M・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,263,462,001円
S M A M・バランスV A株4 0 T<適格機関投資家限定>	826,366円
S M A M・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド <適格機関投資家限定>	4,377,678,068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>	379,170,766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>	384,686,299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>	489,930,987円
合 計	18,855,361,405円

(2023年4月26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	18,855,361,405円
同期中における追加設定元本額	10,023,809,737円
同期中における一部解約元本額	8,499,746,251円
2023年4月26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)	2,567,649,301円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,343,499,078円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	392,892,525円
イオン・バランス戦略ファンド	668,406,963円
三井住友・資産最適化ファンド(1 安定重視型)	2,929,661,404円
三井住友・資産最適化ファンド(2 やや安定型)	1,120,683,571円
三井住友・資産最適化ファンド(3 バランス型)	2,115,322,668円
三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)	522,714,645円
三井住友・資産最適化ファンド(5 成長重視型)	173,824,287円
三井住友・D CつみたてN I S A・世界分散ファンド	73,256,743円
日興F W S・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)	569,188,851円
三井住友D S・F W専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	259,539円
三井住友D S・F W専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	174,238円
三井住友D S・F W専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	117,354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)	66,146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)	15,745円
S M A M・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,112,417,357円
S M A M・バランスV A株4 0 T<適格機関投資家限定>	885,316円
S M A M・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド <適格機関投資家限定>	5,389,448,436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>	433,278,912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>	423,711,441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>	541,950,371円
合 計	20,379,424,891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 0.25 05/15/24	1,160,000.00	1,108,890.40	
		T 0.25 05/31/25	370,000.00	343,337.80	
		T 0.25 06/15/24	620,000.00	591,380.80	
		T 0.25 06/30/25	650,000.00	602,556.50	
		T 0.25 07/31/25	350,000.00	323,393.00	
		T 0.25 08/31/25	590,000.00	543,797.10	
		T 0.25 09/30/25	290,000.00	267,098.70	
		T 0.25 10/31/25	420,000.00	385,396.20	
		T 0.375 04/30/25	520,000.00	484,946.80	
		T 0.375 07/31/27	400,000.00	351,068.00	
		T 0.375 08/15/24	710,000.00	674,535.50	
		T 0.375 09/15/24	700,000.00	663,628.00	
		T 0.375 09/30/27	470,000.00	410,577.90	
		T 0.375 11/30/25	510,000.00	468,419.70	
		T 0.375 12/31/25	1,200,000.00	1,101,600.00	
		T 0.5 02/28/26	550,000.00	503,657.00	
		T 0.5 03/31/25	920,000.00	862,371.20	
		T 0.5 04/30/27	480,000.00	426,532.80	
		T 0.5 05/31/27	370,000.00	328,034.60	
		T 0.5 06/30/27	310,000.00	274,244.60	
		T 0.5 08/31/27	340,000.00	299,376.80	
		T 0.5 10/31/27	400,000.00	350,684.00	
		T 0.625 03/31/27	120,000.00	107,413.20	
		T 0.625 05/15/30	1,140,000.00	944,410.20	
		T 0.625 07/31/26	420,000.00	382,116.00	
		T 0.625 08/15/30	1,030,000.00	848,977.50	
		T 0.625 10/15/24	600,000.00	569,448.00	
		T 0.625 11/30/27	280,000.00	246,470.00	
		T 0.625 12/31/27	350,000.00	307,464.50	
		T 0.75 01/31/28	460,000.00	405,821.20	
		T 0.75 03/31/26	530,000.00	488,644.10	
		T 0.75 04/30/26	500,000.00	459,470.00	
		T 0.75 05/31/26	600,000.00	550,098.00	
		T 0.75 08/31/26	460,000.00	419,234.80	
		T 0.75 11/15/24	200,000.00	189,760.00	
T 0.875 06/30/26	500,000.00	459,870.00			
T 0.875 09/30/26	340,000.00	310,746.40			
T 0.875 11/15/30	760,000.00	636,880.00			

T 1 07/31/28	350,000.00	309,106.00	
T 1 12/15/24	600,000.00	570,678.00	
T 1.125 01/15/25	500,000.00	475,800.00	
T 1.125 02/15/31	740,000.00	630,583.60	
T 1.125 02/28/27	280,000.00	256,334.40	
T 1.125 02/29/28	940,000.00	843,386.80	
T 1.125 05/15/40	270,000.00	182,085.30	
T 1.125 08/15/40	380,000.00	254,166.80	
T 1.125 08/31/28	490,000.00	434,718.20	
T 1.125 10/31/26	500,000.00	459,920.00	
T 1.25 03/31/28	460,000.00	414,538.20	
T 1.25 04/30/28	730,000.00	656,671.50	
T 1.25 05/15/50	680,000.00	399,085.20	
T 1.25 05/31/28	580,000.00	520,886.40	
T 1.25 06/30/28	480,000.00	430,401.60	
T 1.25 08/15/31	920,000.00	780,850.00	
T 1.25 08/31/24	450,000.00	432,058.50	
T 1.25 09/30/28	560,000.00	499,318.40	
T 1.25 11/30/26	400,000.00	369,060.00	
T 1.25 12/31/26	530,000.00	488,310.20	
T 1.375 01/31/25	830,000.00	793,065.00	
T 1.375 08/15/50	450,000.00	272,493.00	
T 1.375 08/31/26	470,000.00	437,490.10	
T 1.375 10/31/28	180,000.00	161,373.60	
T 1.375 11/15/31	1,040,000.00	887,546.40	
T 1.375 11/15/40	530,000.00	369,298.70	
T 1.375 12/31/28	620,000.00	554,788.40	
T 1.5 01/31/27	350,000.00	324,978.50	
T 1.5 02/15/25	100,000.00	95,630.00	
T 1.5 02/15/30	570,000.00	505,270.80	
T 1.5 08/15/26	550,000.00	514,646.00	
T 1.5 11/30/24	510,000.00	489,498.00	
T 1.5 11/30/28	380,000.00	342,562.40	
T 1.625 02/15/26	600,000.00	567,804.00	
T 1.625 05/15/26	570,000.00	537,612.60	
T 1.625 05/15/31	930,000.00	817,944.30	
T 1.625 08/15/29	420,000.00	378,373.80	
T 1.625 09/30/26	480,000.00	450,230.40	
T 1.625 11/15/50	760,000.00	491,666.80	
T 1.625 11/30/26	350,000.00	327,488.00	
T 1.75 01/31/29	540,000.00	492,355.80	
T 1.75 08/15/41	210,000.00	153,671.70	
T 1.75 11/15/29	330,000.00	299,564.10	
T 1.75 12/31/24	390,000.00	375,375.00	

T 1.75 12/31/26	300,000.00	281,601.00	
T 1.875 02/15/32	950,000.00	842,621.50	
T 1.875 02/15/41	490,000.00	370,503.70	
T 1.875 02/15/51	380,000.00	261,744.00	
T 1.875 02/28/27	200,000.00	188,178.00	
T 1.875 02/28/29	550,000.00	504,817.50	
T 1.875 06/30/26	200,000.00	189,846.00	
T 1.875 11/15/51	470,000.00	322,335.40	
T 2 02/15/50	470,000.00	335,598.80	
T 2 08/15/25	600,000.00	576,606.00	
T 2 08/15/51	680,000.00	481,773.20	
T 2 11/15/26	490,000.00	464,637.60	
T 2 11/15/41	590,000.00	449,721.60	
T 2.125 05/31/26	320,000.00	306,217.60	
T 2.25 02/15/27	450,000.00	429,772.50	
T 2.25 02/15/52	500,000.00	375,445.00	
T 2.25 03/31/24	80,000.00	78,268.80	
T 2.25 05/15/41	380,000.00	304,874.00	
T 2.25 08/15/27	570,000.00	542,263.80	
T 2.25 08/15/46	250,000.00	190,307.50	
T 2.25 08/15/49	460,000.00	348,454.60	
T 2.25 11/15/27	570,000.00	540,975.60	
T 2.25 12/31/24	500,000.00	485,175.00	
T 2.375 02/15/42	480,000.00	389,558.40	
T 2.375 03/31/29	290,000.00	273,345.30	
T 2.375 04/30/26	400,000.00	386,020.00	
T 2.375 05/15/27	480,000.00	459,796.80	
T 2.375 05/15/29	300,000.00	282,609.00	
T 2.375 05/15/51	590,000.00	456,453.50	
T 2.375 11/15/49	180,000.00	140,040.00	
T 2.5 02/15/45	220,000.00	177,366.20	
T 2.5 02/15/46	150,000.00	120,219.00	
T 2.5 03/31/27	310,000.00	298,384.30	
T 2.5 04/30/24	1,230,000.00	1,204,391.40	
T 2.5 05/15/46	230,000.00	184,218.50	
T 2.5 05/31/24	500,000.00	489,355.00	
T 2.625 01/31/26	230,000.00	223,764.70	
T 2.625 02/15/29	520,000.00	497,614.00	
T 2.625 05/31/27	280,000.00	270,620.00	
T 2.625 07/31/29	420,000.00	400,835.40	
T 2.625 12/31/25	510,000.00	496,291.20	
T 2.75 02/15/28	420,000.00	407,085.00	
T 2.75 02/28/25	500,000.00	489,175.00	
T 2.75 04/30/27	290,000.00	281,682.80	

T 2.75 05/15/25	890,000.00	870,019.50	
T 2.75 05/31/29	430,000.00	413,703.00	
T 2.75 06/30/25	340,000.00	332,309.20	
T 2.75 07/31/27	350,000.00	339,738.00	
T 2.75 08/15/32	1,000,000.00	949,840.00	
T 2.75 08/15/42	230,000.00	197,786.20	
T 2.75 08/15/47	250,000.00	209,350.00	
T 2.75 11/15/42	270,000.00	231,444.00	
T 2.75 11/15/47	250,000.00	209,477.50	
T 2.875 05/15/28	500,000.00	486,715.00	
T 2.875 05/15/32	910,000.00	874,218.80	
T 2.875 05/15/43	290,000.00	253,164.20	
T 2.875 05/15/49	410,000.00	353,292.90	
T 2.875 05/15/52	520,000.00	447,662.80	
T 2.875 07/31/25	300,000.00	294,057.00	
T 2.875 08/15/28	300,000.00	291,807.00	
T 2.875 08/15/45	110,000.00	94,584.60	
T 2.875 11/15/46	320,000.00	274,892.80	
T 2.875 11/30/25	390,000.00	382,001.10	
T 3 02/15/47	120,000.00	105,246.00	
T 3 02/15/48	360,000.00	316,101.60	
T 3 02/15/49	370,000.00	326,055.10	
T 3 05/15/45	90,000.00	79,137.90	
T 3 05/15/47	300,000.00	262,956.00	
T 3 06/30/24	1,600,000.00	1,573,840.00	
T 3 07/15/25	610,000.00	599,355.50	
T 3 07/31/24	810,000.00	796,497.30	
T 3 08/15/48	480,000.00	421,920.00	
T 3 08/15/52	560,000.00	494,810.40	
T 3 09/30/25	620,000.00	609,168.60	
T 3 11/15/44	220,000.00	194,046.60	
T 3 11/15/45	300,000.00	263,547.00	
T 3.125 02/15/42	150,000.00	137,583.00	
T 3.125 02/15/43	190,000.00	172,658.70	
T 3.125 05/15/48	420,000.00	377,416.20	
T 3.125 08/15/44	320,000.00	288,592.00	
T 3.125 08/31/29	220,000.00	216,088.40	
T 3.125 11/15/28	1,680,000.00	1,652,666.40	
T 3.125 11/15/41	210,000.00	193,120.20	
T 3.25 05/15/42	420,000.00	390,910.80	
T 3.25 06/30/27	280,000.00	277,225.20	
T 3.25 06/30/29	430,000.00	425,295.80	
T 3.25 08/31/24	300,000.00	295,890.00	
T 3.375 05/15/44	300,000.00	281,958.00	

T 3.375 08/15/42	430,000.00	407,119.70	
T 3.375 11/15/48	300,000.00	282,390.00	
T 3.5 01/31/28	1,700,000.00	1,704,301.00	
T 3.5 01/31/30	150,000.00	150,726.00	
T 3.5 02/15/33	890,000.00	898,686.40	
T 3.5 02/15/39	80,000.00	79,954.40	
T 3.625 02/15/44	270,000.00	263,838.60	
T 3.625 02/15/53	1,000,000.00	996,790.00	
T 3.625 08/15/43	230,000.00	225,556.40	
T 3.875 01/15/26	200,000.00	200,996.00	
T 3.875 02/15/43	570,000.00	579,302.40	
T 3.875 08/15/40	40,000.00	41,444.40	
T 3.875 09/30/29	150,000.00	153,723.00	
T 3.875 11/30/27	550,000.00	559,867.00	
T 3.875 11/30/29	440,000.00	451,426.80	
T 3.875 12/31/27	300,000.00	305,367.00	
T 3.875 12/31/29	500,000.00	513,375.00	
T 4 02/15/26	500,000.00	504,550.00	
T 4 02/28/30	350,000.00	362,358.50	
T 4 02/29/28	200,000.00	205,148.00	
T 4 10/31/29	300,000.00	309,795.00	
T 4 11/15/42	700,000.00	724,822.00	
T 4 11/15/52	380,000.00	405,650.00	
T 4 12/15/25	1,270,000.00	1,280,083.80	
T 4.125 01/31/25	3,200,000.00	3,204,224.00	
T 4.125 09/30/27	350,000.00	359,145.50	
T 4.125 10/31/27	200,000.00	205,362.00	
T 4.125 11/15/32	730,000.00	773,340.10	
T 4.25 05/15/39	70,000.00	76,297.20	
T 4.25 11/15/40	140,000.00	151,858.00	
T 4.25 12/31/24	650,000.00	651,534.00	
T 4.375 02/15/38	40,000.00	44,272.40	
T 4.375 05/15/40	140,000.00	154,422.80	
T 4.375 05/15/41	370,000.00	406,485.70	
T 4.375 10/31/24	580,000.00	581,287.60	
T 4.375 11/15/39	150,000.00	165,559.50	
T 4.5 02/15/36	100,000.00	112,228.00	
T 4.5 08/15/39	120,000.00	134,612.40	
T 4.625 02/15/40	100,000.00	113,677.00	
T 4.625 02/28/25	450,000.00	455,130.00	
T 4.625 03/15/26	820,000.00	842,484.40	
T 5.25 11/15/28	200,000.00	218,054.00	
T 5.375 02/15/31	80,000.00	90,965.60	
US TREASURY N/B	780,000.00	748,831.20	

	US TREASURY N/B	520,000.00	495,539.20	
	アメリカ・ドル小計	103,310,000.00	95,392,334.30 (12,763,494,329)	
カナダ・ドル	CAN 0.25 03/01/26	140,000.00	128,522.80	
	CAN 0.25 04/01/24	230,000.00	221,828.10	
	CAN 0.5 09/01/25	180,000.00	168,013.80	
	CAN 0.5 12/01/30	200,000.00	169,186.00	
	CAN 1 06/01/27	140,000.00	129,733.80	
	CAN 1.25 03/01/25	250,000.00	239,617.50	
	CAN 1.25 03/01/27	160,000.00	149,585.60	
	CAN 1.25 06/01/30	330,000.00	298,181.40	
	CAN 1.5 06/01/26	170,000.00	161,841.70	
	CAN 1.5 06/01/31	350,000.00	317,982.00	
	CAN 1.5 09/01/24	230,000.00	222,840.10	
	CAN 1.5 12/01/31	350,000.00	316,095.50	
	CAN 1.75 12/01/53	250,000.00	191,687.50	
	CAN 2 06/01/28	60,000.00	57,733.20	
	CAN 2 06/01/32	220,000.00	206,261.00	
	CAN 2 12/01/51	360,000.00	295,344.00	
	CAN 2.25 06/01/25	160,000.00	156,044.80	
	CAN 2.25 06/01/29	60,000.00	58,353.00	
	CAN 2.25 12/01/29	80,000.00	77,662.40	
	CAN 2.5 06/01/24	250,000.00	245,985.00	
	CAN 2.5 12/01/32	180,000.00	175,546.80	
	CAN 2.75 06/01/33	200,000.00	199,048.00	
	CAN 2.75 09/01/27	40,000.00	39,598.00	
	CAN 2.75 12/01/48	90,000.00	86,873.40	
	CAN 3 10/01/25	210,000.00	207,813.90	
	CAN 3.5 03/01/28	200,000.00	205,184.00	
	CAN 3.5 12/01/45	90,000.00	97,731.90	
CAN 3.75 05/01/25	150,000.00	150,501.00		
CAN 5 06/01/37	120,000.00	148,371.60		
CAN 5.75 06/01/29	110,000.00	128,254.50		
CAN 5.75 06/01/33	70,000.00	87,952.20		
CANADA 2.75 12/01/64	50,000.00	47,907.50		
	カナダ・ドル小計	5,680,000.00	5,387,282.00 (528,977,220)	
オーストラリア・ドル	ACGB 0.25 11/21/24	230,000.00	219,500.50	
	ACGB 0.25 11/21/25	330,000.00	307,008.90	
	ACGB 0.5 09/21/26	310,000.00	283,798.80	
	ACGB 1 11/21/31	380,000.00	312,078.80	
	ACGB 1 12/21/30	130,000.00	109,313.10	
	ACGB 1.25 05/21/32	280,000.00	232,677.20	
	ACGB 1.5 06/21/31	200,000.00	173,114.00	

	ACGB 1.75 06/21/51	160,000.00	100,801.60	
	ACGB 1.75 11/21/32	260,000.00	224,302.00	
	ACGB 2.25 05/21/28	110,000.00	105,091.80	
	ACGB 2.5 05/21/30	170,000.00	161,127.70	
	ACGB 2.75 04/21/24	60,000.00	59,610.00	
	ACGB 2.75 05/21/41	180,000.00	153,932.40	
	ACGB 2.75 06/21/35	120,000.00	110,301.60	
	ACGB 2.75 11/21/27	150,000.00	147,258.00	
	ACGB 2.75 11/21/28	140,000.00	136,537.80	
	ACGB 2.75 11/21/29	210,000.00	203,170.80	
	ACGB 3 03/21/47	70,000.00	60,001.20	
	ACGB 3 11/21/33	140,000.00	134,162.00	
	ACGB 3.25 04/21/25	180,000.00	180,331.20	
	ACGB 3.25 04/21/29	130,000.00	129,889.50	
	ACGB 3.25 06/21/39	110,000.00	102,824.70	
	ACGB 3.75 04/21/37	70,000.00	70,466.20	
	ACGB 3.75 05/21/34	240,000.00	245,582.40	
	ACGB 4.25 04/21/26	170,000.00	175,383.90	
	ACGB 4.5 04/21/33	180,000.00	195,870.60	
	ACGB 4.75 04/21/27	160,000.00	169,491.20	
	オーストラリア・ドル小計	4,870,000.00	4,503,627.90 (399,516,831)	
シンガポール・ドル	SIGB 0.5 11/01/25	70,000.00	65,904.30	
	SIGB 1.875 03/01/50	130,000.00	115,830.00	
	SIGB 2.125 06/01/26	400,000.00	390,800.00	
	SIGB 2.25 08/01/36	210,000.00	199,080.00	
	SIGB 2.375 06/01/25	160,000.00	157,897.60	
	SIGB 2.375 07/01/39	350,000.00	335,604.50	
	SIGB 2.625 05/01/28	120,000.00	118,860.00	
	SIGB 2.75 03/01/46	120,000.00	124,320.00	
	SIGB 2.75 04/01/42	100,000.00	102,646.00	
	SIGB 2.875 07/01/29	150,000.00	150,300.00	
	SIGB 2.875 09/01/30	270,000.00	270,270.00	
	SIGB 3 08/01/72	10,000.00	11,745.00	
	SIGB 3 09/01/24	230,000.00	229,105.30	
	SIGB 3.375 09/01/33	250,000.00	262,500.00	
	シンガポール・ドル小計	2,570,000.00	2,534,862.70 (253,511,619)	
ニュージーランド・ドル	NZGB 0.25 05/15/28	180,000.00	148,622.40	
	NZGB 0.5 05/15/26	200,000.00	178,588.00	
	NZGB 1.75 05/15/41	60,000.00	40,584.00	
	NZGB 2 05/15/32	140,000.00	117,735.80	
	NZGB 2.75 04/15/25	150,000.00	144,792.00	
	NZGB 2.75 04/15/37	90,000.00	75,534.30	

	NZGB 2.75 05/15/51	50,000.00	37,698.50	
	ニュージーランド・ドル小計	870,000.00	743,555.00 (61,112,785)	
イギリス・ ボンド	UK TSY GILT	320,000.00	213,622.40	
	UKT 0.125 01/30/26	110,000.00	99,922.90	
	UKT 0.125 01/31/28	220,000.00	186,709.60	
	UKT 0.25 01/31/25	280,000.00	261,556.40	
	UKT 0.25 07/31/31	250,000.00	190,527.50	
	UKT 0.375 10/22/26	170,000.00	151,347.60	
	UKT 0.375 10/22/30	70,000.00	55,463.80	
	UKT 0.5 01/31/29	290,000.00	242,527.00	
	UKT 0.5 10/22/61	140,000.00	47,831.00	
	UKT 0.625 06/07/25	130,000.00	121,885.40	
	UKT 0.625 07/31/35	240,000.00	165,501.60	
	UKT 0.625 10/22/50	80,000.00	35,428.00	
	UKT 0.875 01/31/46	110,000.00	58,514.50	
	UKT 0.875 07/31/33	70,000.00	53,158.00	
	UKT 0.875 10/22/29	100,000.00	84,697.00	
	UKT 1 01/31/32	250,000.00	200,945.00	
	UKT 1 04/22/24	80,000.00	77,537.60	
	UKT 1.125 10/22/73	290,000.00	122,324.90	
	UKT 1.25 07/22/27	220,000.00	199,777.60	
	UKT 1.25 07/31/51	320,000.00	171,932.80	
	UKT 1.25 10/22/41	310,000.00	199,472.60	
	UKT 1.5 07/22/26	140,000.00	130,813.20	
	UKT 1.5 07/22/47	80,000.00	48,776.00	
	UKT 1.5 07/31/53	140,000.00	79,072.00	
	UKT 1.625 10/22/28	120,000.00	108,511.20	
	UKT 1.625 10/22/54	100,000.00	58,040.00	
	UKT 1.625 10/22/71	130,000.00	69,283.50	
	UKT 1.75 01/22/49	110,000.00	70,189.90	
	UKT 1.75 07/22/57	120,000.00	71,401.20	
	UKT 1.75 09/07/37	170,000.00	129,659.00	
	UKT 2 09/07/25	110,000.00	105,450.40	
	UKT 2.5 07/22/65	120,000.00	86,580.00	
	UKT 2.75 09/07/24	130,000.00	127,645.70	
UKT 3.25 01/22/44	180,000.00	159,782.40		
UKT 3.25 01/31/33	220,000.00	212,038.20		
UKT 3.5 01/22/45	120,000.00	110,271.60		
UKT 3.5 07/22/68	140,000.00	129,964.80		
UKT 3.5 10/22/25	260,000.00	256,146.80		
UKT 3.75 01/29/38	330,000.00	322,311.00		
UKT 3.75 07/22/52	40,000.00	38,171.20		
UKT 3.75 10/22/53	170,000.00	161,544.20		

	UKT 4 01/22/60	110,000.00	111,958.00	
	UKT 4.125 01/29/27	220,000.00	221,621.40	
	UKT 4.25 03/07/36	180,000.00	187,902.00	
	UKT 4.25 06/07/32	210,000.00	220,962.00	
	UKT 4.25 09/07/39	130,000.00	134,149.60	
	UKT 4.25 12/07/27	80,000.00	82,032.80	
	UKT 4.25 12/07/46	160,000.00	164,569.60	
	UKT 4.25 12/07/49	90,000.00	92,987.10	
	UKT 4.25 12/07/55	50,000.00	52,407.50	
	UKT 4.5 09/07/34	150,000.00	160,389.00	
	UKT 4.5 12/07/42	170,000.00	181,308.40	
	UKT 4.75 12/07/30	110,000.00	118,856.10	
	UKT 4.75 12/07/38	110,000.00	120,353.20	
	UKT 5 03/07/25	80,000.00	81,352.00	
	UKT 6 12/07/28	100,000.00	112,040.00	
	イギリス・ポンド小計	8,930,000.00	7,459,224.20 (1,238,082,033)	
イスラエル・シュケル	ILGOV 0.4 10/31/24	300,000.00	282,936.00	
	ILGOV 0.5 02/27/26	110,000.00	99,529.10	
	ILGOV 0.5 04/30/25	210,000.00	195,255.90	
	ILGOV 1 03/31/30	280,000.00	231,302.40	
	ILGOV 1.3 04/30/32	120,000.00	96,597.60	
	ILGOV 1.5 05/31/37	70,000.00	50,596.00	
	ILGOV 1.75 08/31/25	150,000.00	141,924.00	
	ILGOV 2 03/31/27	140,000.00	130,069.80	
	ILGOV 2.25 09/28/28	180,000.00	165,436.20	
	ILGOV 2.8 11/29/52	120,000.00	89,145.60	
	ILGOV 3.75 03/31/24	120,000.00	119,306.40	
	ILGOV 3.75 03/31/47	330,000.00	303,524.10	
	ILGOV 5.5 01/31/42	40,000.00	46,471.20	
	ILGOV 6.25 10/30/26	260,000.00	278,519.80	
	イスラエル・シュケル小計	2,430,000.00	2,230,614.10 (81,847,700)	
デンマーク・クローネ	DGB 0 11/15/24	460,000.00	439,415.00	
	DGB 0 11/15/31	990,000.00	796,524.30	
	DGB 0.25 11/15/52	510,000.00	268,438.50	
	DGB 0.5 11/15/27	570,000.00	518,677.20	
	DGB 0.5 11/15/29	510,000.00	446,535.60	
	DGB 1.75 11/15/25	540,000.00	525,857.40	
	DGB 4.5 11/15/39	920,000.00	1,135,077.60	
	デンマーク・クローネ小計	4,500,000.00	4,130,525.60 (81,330,049)	
	NGB 1.25 09/17/31	390,000.00	334,694.10	
	NGB 1.375 08/19/30	550,000.00	484,924.00	

ノル ウェー・ク ローネ	NGB 1.5 02/19/26	590,000.00	561,709.50	
	NGB 1.75 02/17/27	440,000.00	416,627.20	
	NGB 1.75 03/13/25	410,000.00	397,433.50	
	NGB 1.75 09/06/29	320,000.00	293,702.40	
	NGB 2 04/26/28	310,000.00	292,574.90	
	NGB 2.125 05/18/32	320,000.00	293,020.80	
	NGB 3 08/15/33	200,000.00	196,416.00	
ノルウェー・クローネ小計		3,530,000.00	3,271,102.40	(40,954,202)
スウェーデ ン・クロー ナ	SGB 0.125 05/12/31	380,000.00	315,555.80	
	SGB 0.75 05/12/28	410,000.00	375,703.50	
	SGB 0.75 11/12/29	810,000.00	727,396.20	
	SGB 1 11/12/26	780,000.00	734,089.20	
	SGB 1.75 11/11/33	170,000.00	160,315.10	
	SGB 2.25 06/01/32	500,000.00	490,425.00	
	SGB 2.5 05/12/25	730,000.00	721,802.10	
SGB 3.5 03/30/39	410,000.00	463,189.30		
スウェーデン・クローナ小計		4,190,000.00	3,988,476.20	(51,770,421)
メキシコ・ ペソ	MBONO 10 11/20/36	320,000.00	348,761.60	
	MBONO 10 12/05/24	1,350,000.00	1,334,812.50	
	MBONO 5 03/06/25	2,300,000.00	2,091,183.00	
	MBONO 5.5 03/04/27	1,700,000.00	1,500,913.00	
	MBONO 5.75 03/05/26	3,640,000.00	3,293,763.20	
	MBONO 7.5 05/26/33	2,300,000.00	2,093,920.00	
	MBONO 7.5 06/03/27	3,100,000.00	2,931,980.00	
	MBONO 7.75 05/29/31	4,340,000.00	4,068,576.40	
	MBONO 7.75 11/13/42	2,000,000.00	1,753,660.00	
	MBONO 7.75 11/23/34	920,000.00	847,412.00	
	MBONO 8 09/05/24	2,700,000.00	2,602,017.00	
	MBONO 8 11/07/47	2,990,000.00	2,666,511.90	
	MBONO 8.5 05/31/29	3,470,000.00	3,405,388.60	
MBONO 8.5 11/18/38	1,700,000.00	1,615,561.00		
メキシコ・ペソ小計		32,830,000.00	30,554,460.20	(226,448,271)
オフショ ア・人民元	CGB 2.18 08/25/25	5,600,000.00	5,565,056.00	
	CGB 2.24 05/25/25	1,000,000.00	996,080.00	
	CGB 2.28 11/25/25	4,800,000.00	4,777,104.00	
	CGB 2.44 10/15/27	4,400,000.00	4,365,856.00	
	CGB 2.46 02/15/26	8,900,000.00	8,896,262.00	
	CGB 2.47 09/02/24	4,000,000.00	4,007,840.00	
	CGB 2.48 04/15/27	6,500,000.00	6,467,760.00	
	CGB 2.64 01/15/28	1,300,000.00	1,298,817.00	
CGB 2.69 08/12/26	1,200,000.00	1,205,016.00		

	CGB 2.79 12/15/29	3,000,000.00	2,999,700.00	
	CGB 2.8 11/15/32	3,700,000.00	3,687,790.00	
	CGB 2.91 10/14/28	8,700,000.00	8,788,740.00	
	CGB 3.02 05/27/31	5,600,000.00	5,690,440.00	
	CGB 3.12 10/25/52	1,800,000.00	1,781,964.00	
	CGB 3.72 04/12/51	4,900,000.00	5,371,674.00	
	オフショア・人民元小計	65,400,000.00	65,900,099.00 (1,269,796,058)	
ポーランド・ズロチ	POLGB 0.25 10/25/26	620,000.00	511,735.60	
	POLGB 0.75 04/25/25	590,000.00	534,097.50	
	POLGB 1.25 10/25/30	500,000.00	364,155.00	
	POLGB 1.75 04/25/32	150,000.00	108,195.00	
	POLGB 2.25 10/25/24	860,000.00	815,297.20	
	POLGB 2.5 07/25/26	50,000.00	45,036.50	
	POLGB 2.5 07/25/27	90,000.00	78,709.50	
	POLGB 2.75 04/25/28	50,000.00	43,347.50	
	POLGB 2.75 10/25/29	480,000.00	401,064.00	
	POLGB 3.75 05/25/27	650,000.00	598,104.00	
	POLGB 7.5 07/25/28	310,000.00	330,484.80	
	ポーランド・ズロチ小計	4,350,000.00	3,830,226.60 (122,365,398)	
ユーロ	BGB 0 10/22/27	80,000.00	70,840.80	
	BGB 0 10/22/31	110,000.00	85,941.90	
	BGB 0.1 06/22/30	120,000.00	99,060.00	
	BGB 0.35 06/22/32	270,000.00	213,524.10	
	BGB 0.4 06/22/40	90,000.00	55,648.80	
	BGB 0.5 10/22/24	180,000.00	173,628.00	
	BGB 0.65 06/22/71	30,000.00	12,320.40	
	BGB 0.8 06/22/25	190,000.00	182,016.20	
	BGB 0.8 06/22/27	130,000.00	120,148.60	
	BGB 0.8 06/22/28	160,000.00	145,513.60	
	BGB 0.9 06/22/29	100,000.00	89,635.00	
	BGB 1 06/22/26	210,000.00	198,884.70	
	BGB 1 06/22/31	160,000.00	138,105.60	
	BGB 1.25 04/22/33	100,000.00	85,230.00	
	BGB 1.4 06/22/53	140,000.00	87,424.40	
	BGB 1.45 06/22/37	170,000.00	135,595.40	
	BGB 1.6 06/22/47	100,000.00	70,563.00	
	BGB 1.7 06/22/50	130,000.00	91,154.70	
	BGB 1.9 06/22/38	90,000.00	75,214.80	
	BGB 2.15 06/22/66	80,000.00	59,110.40	
BGB 2.6 06/22/24	90,000.00	89,487.90		
BGB 2.75 04/22/39	160,000.00	148,627.20		
BGB 3 06/22/34	140,000.00	138,290.60		

BGB 3.75 06/22/45	170,000.00	179,078.00	
BGB 4 03/28/32	80,000.00	86,320.80	
BGB 4.5 03/28/26	100,000.00	104,741.00	
BGB 5 03/28/35	170,000.00	200,156.30	
BGB 5.5 03/28/28	160,000.00	180,395.20	
BKO 2.5 03/13/25	470,000.00	467,212.90	
BTPS	220,000.00	210,601.60	
BTPS 0 04/01/26	240,000.00	216,664.80	
BTPS 0 04/15/24	40,000.00	38,714.00	
BTPS 0 08/01/26	220,000.00	196,288.40	
BTPS 0 12/15/24	330,000.00	312,321.90	
BTPS 0.25 03/15/28	300,000.00	254,457.00	
BTPS 0.35 02/01/25	230,000.00	217,975.60	
BTPS 0.45 02/15/29	140,000.00	115,873.80	
BTPS 0.5 02/01/26	310,000.00	285,606.10	
BTPS 0.5 07/15/28	100,000.00	84,879.00	
BTPS 0.6 08/01/31	100,000.00	76,171.00	
BTPS 0.85 01/15/27	390,000.00	353,776.80	
BTPS 0.9 04/01/31	210,000.00	166,173.00	
BTPS 0.95 03/01/37	90,000.00	58,557.60	
BTPS 0.95 06/01/32	120,000.00	91,617.60	
BTPS 0.95 08/01/30	390,000.00	316,566.90	
BTPS 0.95 09/15/27	210,000.00	187,561.50	
BTPS 0.95 12/01/31	100,000.00	77,661.00	
BTPS 1.1 04/01/27	50,000.00	45,519.50	
BTPS 1.25 12/01/26	270,000.00	249,434.10	
BTPS 1.35 04/01/30	140,000.00	118,392.40	
BTPS 1.45 03/01/36	240,000.00	172,152.00	
BTPS 1.45 05/15/25	200,000.00	192,386.00	
BTPS 1.45 11/15/24	250,000.00	242,770.00	
BTPS 1.5 04/30/45	130,000.00	76,850.80	
BTPS 1.5 06/01/25	130,000.00	124,974.20	
BTPS 1.6 06/01/26	230,000.00	217,159.10	
BTPS 1.65 03/01/32	240,000.00	197,352.00	
BTPS 1.65 12/01/30	210,000.00	178,235.40	
BTPS 1.7 09/01/51	140,000.00	79,926.00	
BTPS 1.8 03/01/41	110,000.00	74,265.40	
BTPS 1.85 05/15/24	190,000.00	186,975.20	
BTPS 2 02/01/28	220,000.00	204,226.00	
BTPS 2 12/01/25	220,000.00	211,937.00	
BTPS 2.05 08/01/27	280,000.00	263,012.40	
BTPS 2.1 07/15/26	160,000.00	153,142.40	
BTPS 2.15 03/01/72	50,000.00	28,426.00	
BTPS 2.15 09/01/52	70,000.00	43,757.70	

BTPS 2.2 06/01/27	180,000.00	170,632.80	
BTPS 2.25 09/01/36	170,000.00	133,987.20	
BTPS 2.45 09/01/50	50,000.00	34,183.00	
BTPS 2.5 12/01/24	250,000.00	246,552.50	
BTPS 2.5 12/01/32	200,000.00	174,172.00	
BTPS 2.65 12/01/27	50,000.00	47,909.00	
BTPS 2.7 03/01/47	150,000.00	111,765.00	
BTPS 2.8 03/01/67	90,000.00	61,363.80	
BTPS 2.8 06/15/29	80,000.00	75,480.00	
BTPS 2.8 12/01/28	200,000.00	190,660.00	
BTPS 2.95 09/01/38	330,000.00	275,536.80	
BTPS 3 08/01/29	200,000.00	191,048.00	
BTPS 3.1 03/01/40	200,000.00	167,294.00	
BTPS 3.25 03/01/38	100,000.00	86,747.00	
BTPS 3.25 09/01/46	140,000.00	115,306.80	
BTPS 3.35 03/01/35	300,000.00	271,368.00	
BTPS 3.4 04/01/28	500,000.00	492,850.00	
BTPS 3.45 03/01/48	180,000.00	152,038.80	
BTPS 3.5 01/15/26	300,000.00	299,745.00	
BTPS 3.5 03/01/30	240,000.00	234,696.00	
BTPS 3.75 09/01/24	290,000.00	291,255.70	
BTPS 3.85 09/01/49	140,000.00	125,392.40	
BTPS 3.85 12/15/29	100,000.00	99,610.00	
BTPS 4 02/01/37	250,000.00	239,875.00	
BTPS 4 04/30/35	100,000.00	96,438.00	
BTPS 4.45 09/01/43	300,000.00	294,174.00	
BTPS 4.5 03/01/26	160,000.00	164,243.20	
BTPS 4.75 09/01/28	140,000.00	146,930.00	
BTPS 5 03/01/25	250,000.00	256,950.00	
BTPS 5 08/01/34	250,000.00	264,515.00	
BTPS 5 08/01/39	220,000.00	232,504.80	
BTPS 5 09/01/40	180,000.00	190,443.60	
BTPS 5.25 11/01/29	250,000.00	270,900.00	
BTPS 5.75 02/01/33	240,000.00	269,126.40	
BTPS 6 05/01/31	250,000.00	284,772.50	
BTPS 6.5 11/01/27	190,000.00	212,893.10	
DBR 0 02/15/30	280,000.00	239,503.60	
DBR 0 02/15/31	240,000.00	200,817.60	
DBR 0 02/15/32	250,000.00	204,320.00	
DBR 0 05/15/35	270,000.00	201,825.00	
DBR 0 05/15/36	120,000.00	87,192.00	
DBR 0 08/15/26	320,000.00	294,825.60	
DBR 0 08/15/29	250,000.00	216,135.00	
DBR 0 08/15/30	380,000.00	321,597.80	

DBR 0 08/15/30	110,000.00	93,278.90	
DBR 0 08/15/31	180,000.00	148,959.00	
DBR 0 08/15/31	100,000.00	82,856.00	
DBR 0 08/15/50	280,000.00	148,198.40	
DBR 0 08/15/50	130,000.00	69,056.00	
DBR 0 08/15/52	90,000.00	45,301.50	
DBR 0 11/15/27	220,000.00	197,531.40	
DBR 0 11/15/28	220,000.00	193,248.00	
DBR 0.25 02/15/27	280,000.00	257,812.80	
DBR 0.25 02/15/29	380,000.00	337,109.40	
DBR 0.25 08/15/28	310,000.00	277,549.20	
DBR 0.5 02/15/25	200,000.00	191,978.00	
DBR 0.5 02/15/26	270,000.00	254,772.00	
DBR 0.5 02/15/28	100,000.00	91,554.00	
DBR 0.5 08/15/27	270,000.00	249,145.20	
DBR 1 05/15/38	400,000.00	324,104.00	
DBR 1 08/15/24	210,000.00	204,842.40	
DBR 1 08/15/25	300,000.00	288,684.00	
DBR 1.25 08/15/48	380,000.00	298,695.20	
DBR 1.5 05/15/24	390,000.00	384,036.90	
DBR 1.7 08/15/32	160,000.00	151,526.40	
DBR 1.8 08/15/53	270,000.00	233,066.70	
DBR 2.1 11/15/29	100,000.00	98,341.00	
DBR 2.3 02/15/33	270,000.00	268,150.50	
DBR 2.5 07/04/44	270,000.00	271,120.50	
DBR 2.5 08/15/46	200,000.00	202,400.00	
DBR 4 01/04/37	260,000.00	305,099.60	
DBR 4.25 07/04/39	200,000.00	245,500.00	
DBR 4.75 07/04/28	170,000.00	189,580.60	
DBR 4.75 07/04/34	230,000.00	282,235.30	
DBR 4.75 07/04/40	160,000.00	209,443.20	
DBR 5.5 01/04/31	220,000.00	268,400.00	
DBR 5.625 01/04/28	160,000.00	182,635.20	
DBR 6.25 01/04/30	130,000.00	161,224.70	
DBR 6.5 07/04/27	160,000.00	185,531.20	
FRANCE 0.A.T.	200,000.00	104,124.00	
FRTR 0 02/25/25	490,000.00	464,436.70	
FRTR 0 02/25/26	310,000.00	286,626.00	
FRTR 0 02/25/27	350,000.00	315,493.50	
FRTR 0 03/25/25	510,000.00	482,470.20	
FRTR 0 05/25/32	310,000.00	240,101.20	
FRTR 0 11/25/29	850,000.00	711,314.00	
FRTR 0 11/25/30	600,000.00	487,554.00	
FRTR 0 11/25/31	380,000.00	299,375.40	

FRTR 0.25 11/25/26	360,000.00	329,547.60	
FRTR 0.5 05/25/25	590,000.00	561,680.00	
FRTR 0.5 05/25/26	480,000.00	448,080.00	
FRTR 0.5 05/25/29	200,000.00	175,268.00	
FRTR 0.5 05/25/40	330,000.00	212,840.10	
FRTR 0.5 05/25/72	80,000.00	31,109.60	
FRTR 0.5 06/25/44	120,000.00	70,603.20	
FRTR 0.75 02/25/28	470,000.00	428,221.70	
FRTR 0.75 05/25/28	620,000.00	562,377.20	
FRTR 0.75 05/25/52	230,000.00	123,109.80	
FRTR 0.75 11/25/28	500,000.00	449,560.00	
FRTR 1 05/25/27	70,000.00	65,338.70	
FRTR 1 11/25/25	250,000.00	238,765.00	
FRTR 1.25 05/25/34	300,000.00	250,455.00	
FRTR 1.25 05/25/36	390,000.00	312,347.10	
FRTR 1.25 05/25/38	120,000.00	92,287.20	
FRTR 1.5 05/25/31	480,000.00	436,747.20	
FRTR 1.5 05/25/50	290,000.00	198,652.90	
FRTR 1.75 05/25/66	120,000.00	80,544.00	
FRTR 1.75 06/25/39	170,000.00	140,183.70	
FRTR 1.75 11/25/24	300,000.00	294,243.00	
FRTR 2 05/25/48	160,000.00	125,344.00	
FRTR 2 11/25/32	680,000.00	630,013.20	
FRTR 2.25 05/25/24	290,000.00	287,149.30	
FRTR 2.5 05/25/30	390,000.00	383,997.90	
FRTR 2.5 05/25/43	370,000.00	327,250.20	
FRTR 2.5 09/24/26	350,000.00	346,321.50	
FRTR 2.75 10/25/27	470,000.00	470,432.40	
FRTR 3 05/25/54	250,000.00	232,810.00	
FRTR 3.25 05/25/45	280,000.00	278,784.80	
FRTR 3.5 04/25/26	320,000.00	326,438.40	
FRTR 4 04/25/55	150,000.00	169,701.00	
FRTR 4 04/25/60	170,000.00	193,835.70	
FRTR 4 10/25/38	210,000.00	230,252.40	
FRTR 4.5 04/25/41	350,000.00	409,552.50	
FRTR 4.75 04/25/35	200,000.00	233,290.00	
FRTR 5.5 04/25/29	340,000.00	390,789.20	
FRTR 5.75 10/25/32	320,000.00	395,411.20	
FRTR 6 10/25/25	180,000.00	193,384.80	
IRISH 0 10/18/31	50,000.00	39,687.50	
IRISH 0.2 05/15/27	120,000.00	108,654.00	
IRISH 0.2 10/18/30	80,000.00	66,848.00	
IRISH 0.35 10/18/32	50,000.00	39,980.50	
IRISH 0.4 05/15/35	40,000.00	29,742.00	

IRISH 0.9 05/15/28	80,000.00	73,437.60	
IRISH 1 05/15/26	70,000.00	66,494.40	
IRISH 1.1 05/15/29	50,000.00	45,847.50	
IRISH 1.3 05/15/33	50,000.00	43,366.50	
IRISH 1.35 03/18/31	60,000.00	54,368.40	
IRISH 1.5 05/15/50	70,000.00	48,503.70	
IRISH 1.7 05/15/37	40,000.00	33,849.20	
IRISH 2 02/18/45	40,000.00	32,347.60	
IRISH 2.4 05/15/30	100,000.00	98,668.00	
IRISH 3 10/18/43	20,000.00	19,447.40	
IRISH 5.4 03/13/25	100,000.00	104,771.00	
IRISH GOVT	150,000.00	96,432.00	
NETHER 0 01/15/26	170,000.00	157,829.70	
NETHER 0 01/15/27	250,000.00	226,710.00	
NETHER 0 01/15/29	110,000.00	94,778.20	
NETHER 0 01/15/38	80,000.00	53,129.60	
NETHER 0 01/15/52	130,000.00	62,237.50	
NETHER 0 07/15/30	120,000.00	99,510.00	
NETHER 0 07/15/31	150,000.00	120,934.50	
NETHER 0.25 07/15/25	190,000.00	179,778.00	
NETHER 0.25 07/15/29	130,000.00	112,500.70	
NETHER 0.5 01/15/40	170,000.00	118,535.90	
NETHER 0.5 07/15/26	160,000.00	149,320.00	
NETHER 0.5 07/15/32	100,000.00	82,415.00	
NETHER 0.75 07/15/27	70,000.00	64,768.90	
NETHER 0.75 07/15/28	120,000.00	109,206.00	
NETHER 2 01/15/54	50,000.00	42,786.00	
NETHER 2 07/15/24	70,000.00	69,227.20	
NETHER 2.5 01/15/33	140,000.00	137,727.80	
NETHER 2.5 07/15/33	250,000.00	246,042.50	
NETHER 2.75 01/15/47	220,000.00	221,135.20	
NETHER 3.75 01/15/42	30,000.00	34,129.20	
NETHER 4 01/15/37	180,000.00	203,783.40	
NETHER 5.5 01/15/28	90,000.00	101,160.90	
OBL 0 04/05/24	120,000.00	116,670.00	
OBL 0 04/10/26	100,000.00	92,757.00	
OBL 0 04/11/25	360,000.00	341,211.60	
OBL 0 04/16/27	240,000.00	217,912.80	
OBL 0 10/09/26	220,000.00	201,960.00	
OBL 0 10/10/25	100,000.00	93,744.00	
OBL 0 10/10/25	110,000.00	103,313.10	
OBL 0 10/18/24	310,000.00	297,144.30	
OBL 1.3 10/15/27	470,000.00	447,891.20	
RAGB 0 02/20/30	70,000.00	57,640.80	

RAGB 0 02/20/31	100,000.00	79,809.00	
RAGB 0 04/20/25	90,000.00	84,976.20	
RAGB 0 07/15/24	60,000.00	57,876.00	
RAGB 0 10/20/28	230,000.00	197,487.20	
RAGB 0 10/20/40	120,000.00	69,460.80	
RAGB 0.25 10/20/36	90,000.00	61,785.00	
RAGB 0.5 02/20/29	110,000.00	96,457.90	
RAGB 0.5 04/20/27	110,000.00	100,639.00	
RAGB 0.7 04/20/71	50,000.00	22,447.50	
RAGB 0.75 02/20/28	120,000.00	109,183.20	
RAGB 0.75 10/20/26	150,000.00	140,199.00	
RAGB 0.9 02/20/32	180,000.00	151,408.80	
RAGB 1.2 10/20/25	130,000.00	125,039.20	
RAGB 1.5 02/20/47	70,000.00	51,262.40	
RAGB 1.5 11/02/86	100,000.00	59,821.00	
RAGB 1.65 10/21/24	80,000.00	78,478.40	
RAGB 1.85 05/23/49	110,000.00	85,396.30	
RAGB 2.4 05/23/34	60,000.00	56,424.00	
RAGB 2.9 02/20/33	40,000.00	39,586.00	
RAGB 3.15 06/20/44	50,000.00	50,212.00	
RAGB 3.8 01/26/62	50,000.00	57,782.00	
RAGB 4.15 03/15/37	90,000.00	99,850.50	
RAGB 4.85 03/15/26	100,000.00	105,661.00	
RAGB 6.25 07/15/27	80,000.00	90,728.80	
RFGB 0 09/15/24	60,000.00	57,617.40	
RFGB 0 09/15/26	100,000.00	91,233.00	
RFGB 0 09/15/30	50,000.00	40,517.50	
RFGB 0.125 04/15/36	40,000.00	27,272.80	
RFGB 0.125 04/15/52	20,000.00	9,204.80	
RFGB 0.125 09/15/31	40,000.00	31,810.00	
RFGB 0.25 09/15/40	20,000.00	12,322.80	
RFGB 0.5 04/15/26	40,000.00	37,498.80	
RFGB 0.5 04/15/43	30,000.00	18,405.30	
RFGB 0.5 09/15/27	40,000.00	36,376.40	
RFGB 0.5 09/15/28	60,000.00	53,250.00	
RFGB 0.5 09/15/29	50,000.00	43,294.00	
RFGB 0.75 04/15/31	60,000.00	50,878.20	
RFGB 0.875 09/15/25	100,000.00	95,570.00	
RFGB 1.125 04/15/34	100,000.00	82,276.00	
RFGB 1.375 04/15/47	50,000.00	36,302.00	
RFGB 1.5 09/15/32	50,000.00	44,138.50	
RFGB 2.625 07/04/42	60,000.00	55,915.80	
RFGB 2.75 07/04/28	40,000.00	40,003.20	
SPGB 0 01/31/25	530,000.00	502,662.60	

SPGB 0 01/31/26	160,000.00	147,369.60	
SPGB 0 01/31/27	210,000.00	187,590.90	
SPGB 0 01/31/28	270,000.00	233,817.30	
SPGB 0 05/31/24	270,000.00	260,784.90	
SPGB 0 05/31/25	210,000.00	197,095.50	
SPGB 0.1 04/30/31	170,000.00	132,970.60	
SPGB 0.25 07/30/24	180,000.00	173,570.40	
SPGB 0.5 04/30/30	180,000.00	150,285.60	
SPGB 0.5 10/31/31	200,000.00	159,308.00	
SPGB 0.6 10/31/29	200,000.00	170,674.00	
SPGB 0.7 04/30/32	350,000.00	279,723.50	
SPGB 0.8 07/30/27	240,000.00	218,865.60	
SPGB 0.8 07/30/29	310,000.00	268,974.60	
SPGB 0.85 07/30/37	120,000.00	82,428.00	
SPGB 1 07/30/42	180,000.00	111,477.60	
SPGB 1 10/31/50	90,000.00	47,138.40	
SPGB 1.2 10/31/40	290,000.00	194,543.60	
SPGB 1.25 10/31/30	240,000.00	209,037.60	
SPGB 1.3 10/31/26	250,000.00	236,175.00	
SPGB 1.4 04/30/28	290,000.00	267,893.30	
SPGB 1.4 07/30/28	180,000.00	165,546.00	
SPGB 1.45 04/30/29	100,000.00	91,095.00	
SPGB 1.45 10/31/27	180,000.00	168,062.40	
SPGB 1.45 10/31/71	70,000.00	33,044.20	
SPGB 1.5 04/30/27	190,000.00	179,246.00	
SPGB 1.6 04/30/25	200,000.00	194,586.00	
SPGB 1.85 07/30/35	290,000.00	241,375.70	
SPGB 1.9 10/31/52	300,000.00	194,307.00	
SPGB 1.95 04/30/26	230,000.00	223,150.60	
SPGB 1.95 07/30/30	260,000.00	239,428.80	
SPGB 2.15 10/31/25	160,000.00	156,979.20	
SPGB 2.35 07/30/33	160,000.00	145,419.20	
SPGB 2.55 10/31/32	110,000.00	102,751.00	
SPGB 2.75 10/31/24	230,000.00	228,859.20	
SPGB 2.8 05/31/26	150,000.00	148,810.50	
SPGB 2.9 10/31/46	150,000.00	128,665.50	
SPGB 3.45 07/30/43	50,000.00	46,901.00	
SPGB 3.45 07/30/66	130,000.00	116,331.80	
SPGB 3.9 07/30/39	190,000.00	192,131.80	
SPGB 4.2 01/31/37	200,000.00	211,936.00	
SPGB 4.65 07/30/25	140,000.00	144,935.00	
SPGB 4.7 07/30/41	100,000.00	111,596.00	
SPGB 4.9 07/30/40	180,000.00	205,414.20	
SPGB 5.15 10/31/28	150,000.00	165,276.00	

	SPGB 5.15 10/31/44	160,000.00	190,097.60	
	SPGB 5.75 07/30/32	220,000.00	262,631.60	
	SPGB 5.9 07/30/26	110,000.00	119,609.60	
	SPGB 6 01/31/29	210,000.00	241,959.90	
	ユーロ小計	63,880,000.00	58,235,716.60 (8,547,256,125)	
国債証券合計			25,666,463,041 (25,666,463,041)	
合 計			25,666,463,041 (25,666,463,041)	

(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 215銘柄	49.5%	49.7%
カナダ・ドル	国債証券 32銘柄	2.1%	2.1%
オーストラリア・ドル	国債証券 27銘柄	1.5%	1.6%
シンガポール・ドル	国債証券 14銘柄	1.0%	1.0%
ニュージーランド・ドル	国債証券 7銘柄	0.2%	0.2%
イギリス・ポンド	国債証券 56銘柄	4.8%	4.8%
イスラエル・シェケル	国債証券 14銘柄	0.3%	0.3%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	0.3%	0.3%
ノルウェー・クローネ	国債証券 9銘柄	0.2%	0.2%
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.2%	0.2%
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	0.9%	0.9%
オフショア・人民元	国債証券 15銘柄	4.9%	4.9%
ポーランド・ズロチ	国債証券 11銘柄	0.5%	0.5%
ユーロ	国債証券 335銘柄	33.2%	33.3%

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。

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4月26日現在)	(2023年4月26日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	960,122	1,272,611
コール・ローン	48,427,834	57,096,830
投資証券	8,247,387,550	11,894,179,800
派生商品評価勘定	2,395,600	567,600
未収入金	-	361,845
未収配当金	69,756,673	100,155,423
差入委託証拠金	2,330,000	2,200,000
流動資産合計	8,371,257,779	12,055,834,109
資産合計	8,371,257,779	12,055,834,109

負債の部		
流動負債		
前受金	2,440,000	502,000
未払解約金	2,949,776	9,141,726
その他未払費用	169	175
流動負債合計	5,389,945	9,643,901
負債合計	5,389,945	9,643,901
純資産の部		
元本等		
元本	3,142,280,407	4,656,679,582
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	5,223,587,427	7,389,510,626
元本等合計	8,365,867,834	12,046,190,208
純資産合計	8,365,867,834	12,046,190,208
負債純資産合計	8,371,257,779	12,055,834,109

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2022年4月27日 至 2023年4月26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>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項 目	(2022年4月26日現在)	(2023年4月26日現在)

1. 当計算期間の末日における受益権の総数	3,142,280,407口	4,656,679,582口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.6624円 (1万口当たりの純資産額26,624円)	1口当たり純資産額 2.5869円 (1万口当たりの純資産額25,869円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年4月27日 至 2023年4月26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 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、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、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>
--------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年4月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
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4月26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0406月	37,204,400	-	39,600,000	2,395,600
	小計	37,204,400	-	39,600,000	2,395,600
合計		37,204,400	-	39,600,000	2,395,600

(2023年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	リート指数先物取引 買建				
	TREIT先物0506月	36,382,400	-	36,950,000	567,600
	小計	36,382,400	-	36,950,000	567,600
合計		36,382,400	-	36,950,000	567,600

(注) 1. 時価の算定方法

リート指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2)リート指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2022年4月27日 至 2023年4月26日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2022年4月26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	3,071,522,148円
同期中における追加設定元本額	2,198,779,564円
同期中における一部解約元本額	2,128,021,305円
2022年4月26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)	74,332,453円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	144,802,192円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	113,294,756円

三井住友・DC日本リートインデックスファンド	1,953,407,139円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	13,792,150円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	55,523,511円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	40,771,712円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	135,968,837円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	74,606,058円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	58,817,013円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	24,699,702円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,673,254円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	58,102,181円
日興FWS・Jリートインデックス	181,297,356円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	1,894,768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>	3,536,609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>	47,867,823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>	32,115,891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>	40,704,739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>	85,072,263円
合計	3,142,280,407円

(2023年4月26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	3,142,280,407円
同期中における追加設定元本額	2,675,443,232円
同期中における一部解約元本額	1,161,044,057円
2023年4月26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)	106,278,351円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	226,277,045円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	145,951,570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	2,414,888,532円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	16,625,490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)	108,066,777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	36,836,717円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,116,803円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	200,922,509円
日興FWS・Jリートインデックス	463,897,650円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	55,408,102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Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	65,394,901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>	65,793,891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>	83,971,169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>	215,671,399円
合計	4,656,679,582円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	228	25,444,800	
	サンケイリアルエステート投資法人	358	29,642,400	
	SOSILA物流リート投資法人	569	75,563,200	
	東海道リート投資法人	187	21,879,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	394	257,676,000	
	森ヒルズリート投資法人	1,342	206,533,800	
	産業ファンド投資法人	1,739	268,849,400	
	アドバンス・レジデンス投資法人	1,140	395,580,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	836	176,061,600	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	602	235,683,000	
	GLP投資法人	3,679	557,000,600	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	545	183,120,000	
	日本プロロジスリート投資法人	1,922	586,210,000	
	星野リゾート・リート投資法人	199	141,887,000	
	Oneリート投資法人	198	47,163,600	
	イオンリート投資法人	1,308	200,254,800	
	ヒューリックリート投資法人	1,068	166,501,200	
日本リート投資法人	369	117,342,000		
積水ハウス・リート投資法人	3,430	265,825,000		
トーセイ・リート投資法人	249	33,067,200		

ケネディクス商業リート投資法人	494	119,251,600	
ヘルスケア&メディカル投資法人	278	44,897,000	
サムティ・レジデンシャル投資法人	254	29,133,800	
野村不動産マスターファンド投資法人	3,686	580,176,400	
いちごホテルリート投資法人	190	20,064,000	
ラサールロジポート投資法人	1,397	221,843,600	
スターアジア不動産投資法人	1,432	79,332,800	
マリモ地方創生リート投資法人	172	21,947,200	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	449	229,439,000	
大江戸温泉リート投資法人	177	11,646,600	
投資法人みらい	1,396	64,076,400	
三菱地所物流リート投資法人	391	161,092,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	491	91,031,400	
ザイマックス・リート投資法人	181	19,548,000	
タカラレーベン不動産投資法人	534	48,647,400	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	494	67,035,800	
日本ビルファンド投資法人	1,330	739,480,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	1,168	623,712,000	
日本都市ファンド投資法人	5,754	567,919,800	
オリックス不動産投資法人	2,273	399,820,700	
日本プライムリアルティ投資法人	780	272,610,000	
N T T 都市開発リート投資法人	1,099	145,617,500	
東急リアル・エステート投資法人	766	137,650,200	
グローバル・ワン不動産投資法人	839	88,095,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	2,551	380,864,300	
森トラストリート投資法人	2,123	150,308,400	
インヴィンシブル投資法人	5,024	293,401,600	
フロンティア不動産投資法人	422	205,936,000	
平和不動産リート投資法人	782	123,556,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	770	241,010,000	
福岡リート投資法人	590	94,695,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	664	201,192,000	
いちごオフィスリート投資法人	939	87,890,400	
大和証券オフィス投資法人	236	139,712,000	
阪急阪神リート投資法人	515	74,572,000	
スターツプロシード投資法人	197	44,935,700	
大和ハウスリート投資法人	1,719	494,556,300	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	3,680	284,832,000	
大和証券リビング投資法人	1,556	178,317,600	
ジャパンエクセレント投資法人	1,049	123,047,700	
投資証券 小計		11,894,179,800	

合 計	11,894,179,800	
-----	----------------	--

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)

	(2022年4月26日現在)	(2023年4月26日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	257,992,966	392,912,925
金銭信託	2,592,223	945,305
コール・ローン	130,749,860	42,411,962
投資証券	23,371,768,716	25,711,873,581
派生商品評価勘定	-	111,677
未収入金	1,057,708	1,023,778
未収配当金	19,378,538	29,745,104
流動資産合計	23,783,540,011	26,179,024,332
資産合計	23,783,540,011	26,179,024,332
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,182,626	44,342
未払解約金	11,984,072	35,803,679
その他未払費用	220	147
流動負債合計	13,166,918	35,848,168
負債合計	13,166,918	35,848,168
純資産の部		
元本等		
元本	7,379,512,147	9,786,238,628
剰余金		
剰余金又は欠損金()	16,390,860,946	16,356,937,536
元本等合計	23,770,373,093	26,143,176,164
純資産合計	23,770,373,093	26,143,176,164
負債純資産合計	23,783,540,011	26,179,024,332

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2022年4月27日 至 2023年4月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。

	<p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券</p> <p>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券</p> <p>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 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>

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	（2022年4月26日現在）	（2023年4月26日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	7,379,512,147口	9,786,238,628口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.2211円 （1万口当たりの純資産額32,211円）	1口当たり純資産額 2.6714円 （1万口当たりの純資産額26,714円）

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年4月27日 至 2023年4月26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>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年4月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資証券）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
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4月26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	78,000,000	-	77,319,579	680,421
	カナダ・ドル	1,800,000	-	1,782,470	17,530
	オーストラリア・ドル	9,300,000	-	9,098,200	201,800
	香港・ドル	1,500,000	-	1,485,772	14,228
	シンガポール・ドル	3,000,000	-	2,963,276	36,724
	イギリス・ポンド	6,800,000	-	6,650,632	149,368
	ユーロ	4,800,000	-	4,717,445	82,555
	小計	105,200,000	-	104,017,374	1,182,626
合計	105,200,000	-	104,017,374	1,182,626	

(2023年4月26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	21,200,000	-	21,155,658	44,342
	小計	21,200,000	-	21,155,658	44,342
	売建				
	アメリカ・ドル	28,800,000	-	28,688,323	111,677
	小計	28,800,000	-	28,688,323	111,677
合計	50,000,000	-	49,843,981	67,335	

(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。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2022年4月27日 至 2023年4月26日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2022年4月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	4,897,225,610円
同期中における追加設定元本額	3,515,870,384円
同期中における一部解約元本額	1,033,583,847円
2022年4月26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)	14,691,068円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	15,848,872円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	10,883,264円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	6,414,868,609円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	4,238,171円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	50,724,245円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	36,847,018円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	121,474,215円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	63,639,316円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	52,163,859円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	63,412,875円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	551,319円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド	132,295,590円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	65,236,916円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	168,671,758円
三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド	3,412,797円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	37,893,158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>	43,784,034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>	78,875,063円
合計	7,379,512,147円

(2023年4月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	7,379,512,147円

同期中における追加設定元本額	3,125,237,771円
同期中における一部解約元本額	718,511,290円
2023年4月26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)	17,744,118円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	22,881,934円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	14,260,020円
イオン・バランス戦略ファンド	106,804,485円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	7,877,234,525円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	7,518,523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)	101,405,598円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	80,533,577円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	105,914,022円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	936,183円
三井住友D S・外国リートインデックス年金ファンド	366,784,512円
日興F W S・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	96,992,357円
日興F W S・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	476,889,037円
三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド	45,174,711円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	7,339円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	7,706円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	9,541円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	11,376円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	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>	41,936,211円
S M D A M・リスクコントロール型バランスファンド2021 05(リスク3%) <適格機関投資家限定>	90,004,296円
合計	9,786,238,628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	191,807.77	
		AGREE REALTY CORP	13,650.00	912,093.00	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	12,195.00	230,485.50	

ALEXANDER'S INC	300.00	54,345.00	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	24,599.00	2,965,163.46	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	2,165.00	34,315.25	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	7,000.00	121,730.00	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	48,526.00	1,576,609.74	
AMERICOLD REALTY TRUST INC	41,510.00	1,207,110.80	
APARTMENT INCOME REIT CO	23,374.00	822,998.54	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	23,200.00	178,176.00	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	32,409.00	484,190.46	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	8,429.00	97,439.24	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	2,515.00	8,701.90	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,476.00	3,685,066.84	
BLUEROCK HOMES TRUST INC	468.00	8,840.52	
BOSTON PROPERTIES INC	22,712.00	1,142,413.60	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	8,400.00	30,660.00	
BRANDYWINE REALTY TRUST	34,607.00	132,890.88	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	45,489.00	938,438.07	
BROADSTONE NET LEASE INC	25,945.00	410,968.80	
BRT APARTMENTS CORP	500.00	9,140.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	16,854.00	1,767,310.44	
CARETRUST REIT INC	16,295.00	310,582.70	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	3,648.00	84,378.24	
CENTERSPACE	2,600.00	142,688.00	
CHATHAM LODGING TRUST	5,557.00	55,736.71	
CITY OFFICE REIT INC	4,603.00	26,881.52	
CLIPPER REALTY INC	800.00	4,128.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3,216.00	114,393.12	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	16,866.00	373,244.58	
COUSINS PROPERTIES INC	22,991.00	478,672.62	
CTO REALTY GROWTH INC	3,839.00	64,264.86	
CUBESMART	34,460.00	1,567,240.80	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	33,165.00	262,335.15	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	69,000.00	31,050.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	44,536.00	4,348,495.04	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	23,884.00	21,543.36	
DOUGLAS EMMETT INC	26,346.00	325,109.64	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	20,000.00	2,740.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	11,869.00	162,011.85	
EASTGROUP PROPERTIES INC	6,741.00	1,106,737.38	
ELME COMMUNITIES	15,190.00	263,850.30	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	21,276.00	124,464.60	
EPR PROPERTIES	11,259.00	458,691.66	
EQUINIX INC	14,267.00	10,130,568.69	
EQUITY COMMONWEALTH	17,598.00	359,879.10	

EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	27,136.00	1,845,519.36	
EQUITY RESIDENTIAL	53,125.00	3,215,125.00	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	21,200.00	508,588.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,829.00	2,043,154.23	
EXTRA SPACE STORAGE INC	20,647.00	3,104,069.98	
FARMLAND PARTNERS INC	9,324.00	96,130.44	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	11,020.00	1,056,377.20	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	20,455.00	1,051,387.00	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	13,780.00	348,771.80	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	15,115.00	17,835.70	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	39,106.00	2,001,445.08	
GETTY REALTY CORP	6,971.00	231,646.33	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5,368.00	63,235.04	
GLADSTONE LAND CORP	4,464.00	71,647.20	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	12,642.00	115,295.04	
GLOBAL NET LEASE INC	19,113.00	211,963.17	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	59,433.00	1,143,490.92	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	82,819.00	1,748,309.09	
HERSHA HOSPITALITY TRUST-A	4,276.00	26,853.28	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	16,359.00	368,077.50	
HOST HOTELS & RESORTS INC	108,783.00	1,731,825.36	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	17,289.00	89,729.91	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	36,893.00	579,957.96	
INDUS REALTY TRUST INC	823.00	54,754.19	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	6,274.00	12,297.04	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	4,322.00	285,900.30	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	11,866.00	259,746.74	
INVITATION HOMES INC	89,111.00	2,884,523.07	
IRON MOUNTAIN INC	44,819.00	2,431,878.94	
JBG SMITH PROPERTIES	14,792.00	202,058.72	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	130,900.00	51,051.00	
KILROY REALTY CORP	16,719.00	484,516.62	
KIMCO REALTY CORP	93,700.00	1,767,182.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	34,000.00	687,820.00	
LIFE STORAGE INC	13,356.00	1,769,002.20	
LTC PROPERTIES INC	7,251.00	245,301.33	
LXP INDUSTRIAL TRUST	43,773.00	407,088.90	
MACERICH CO/THE	30,200.00	289,014.00	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	245,900.00	44,507.90	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	87,798.00	705,895.92	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	17,791.00	2,630,221.44	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	28,055.00	1,208,889.95	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	13,122.00	501,391.62	
NATL HEALTH INVESTORS INC	6,051.00	295,772.88	

NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	17,023.00	90,562.36	
NETSTREIT CORP	8,448.00	147,417.60	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	7,478.00	76,948.62	
NEXPOINT RESIDENTIAL	3,529.00	148,747.35	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	9,538.00	62,473.90	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	36,338.00	950,238.70	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,352.00	51,132.48	
ORION OFFICE REIT INC	5,199.00	31,817.88	
PARAMOUNT GROUP INC	20,155.00	84,651.00	
PARK HOTELS & RESORTS INC	35,722.00	415,446.86	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	22,459.00	312,853.87	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	17,364.00	539,499.48	
PHYSICIANS REALTY TRUST	36,597.00	517,847.55	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	19,902.00	123,193.38	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,774.00	94,191.02	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	1,424.00	20,818.88	
PRIME US REIT	130,700.00	35,289.00	
PROLOGIS INC	142,628.00	17,206,641.92	
PUBLIC STORAGE	24,370.00	7,067,300.00	
REALTY INCOME CORP	96,767.00	6,003,424.68	
REGENCY CENTERS CORP	24,384.00	1,468,160.64	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	22,092.00	287,416.92	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	28,980.00	1,592,161.20	
RLJ LODGING TRUST	24,132.00	241,078.68	
RPT REALTY	11,788.00	106,681.40	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	8,924.00	789,774.00	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	32,679.00	355,874.31	
SAFEHOLD INC	5,574.00	157,075.32	
SAUL CENTERS INC	2,331.00	83,240.01	
SERVICE PROPERTIES TRUST	25,446.00	223,161.42	
SIMON PROPERTY GROUP INC	50,758.00	5,543,788.76	
SITE CENTERS CORP	26,013.00	317,618.73	
SL GREEN REALTY CORP	9,537.00	220,686.18	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	20,717.00	775,022.97	
STAG INDUSTRIAL INC	27,802.00	934,147.20	
STAR HOLDINGS	2,111.00	34,725.95	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	14,098.00	88,535.44	
SUN COMMUNITIES INC	19,100.00	2,650,316.00	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	32,379.00	305,981.55	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	15,336.00	282,795.84	
TERRENO REALTY CORP	11,336.00	692,062.80	
UDR INC	48,632.00	1,987,103.52	
UMH PROPERTIES INC	6,284.00	92,751.84	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,344.00	62,267.52	

	URBAN EDGE PROPERTIES	20,402.00	293,380.76	
	URSTADT BIDDLE - CLASS A	6,208.00	106,715.52	
	VENTAS INC	62,544.00	2,899,539.84	
	VERIS RESIDENTIAL INC	10,798.00	167,584.96	
	VICI PROPERTIES INC	154,739.00	5,114,123.95	
	VORNADO REALTY TRUST	24,385.00	363,580.35	
	WELLTOWER INC	73,372.00	5,604,887.08	
	WHITESTONE REIT	4,511.00	39,832.13	
	WP CAREY INC	32,915.00	2,422,214.85	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	17,827.00	223,907.12	
	アメリカ・ドル小計	3,938,997.00	147,228,524.37 (19,699,176,561)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	8,800.00	213,048.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	9,662.00	69,276.54	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	4,023.00	47,230.02	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,190.00	186,774.50	
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	2,642.00	47,291.80	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	13,622.00	46,042.36	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	12,440.00	603,215.60	
	CHOICE PROPERTIES REIT	23,858.00	350,235.44	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	10,639.00	164,904.50	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	10,500.00	170,415.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	17,899.00	265,800.15	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,465.00	74,050.75	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	11,377.00	37,999.18	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	14,775.00	234,036.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	5,260.00	447,100.00	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	21,001.00	248,651.84	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	1,387.00	4,688.06	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11,198.00	144,342.22	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	8,107.00	137,575.79	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,447.00	20,547.40	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1,557.00	26,562.42	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	4,345.00	42,189.95	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	20,754.00	169,975.26	
	PRIMARIS REIT	6,318.00	85,040.28	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	21,805.00	460,303.55	
	SLATE GROCERY REIT-CL U	3,196.00	42,187.20	
	SLATE OFFICE REIT	3,663.00	7,728.93	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	12,000.00	318,240.00		
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4,770.00	15,693.30		
	カナダ・ドル小計	275,700.00	4,681,146.04 (459,641,730)	
	ABACUS PROPERTY GROUP	50,980.00	136,116.60	

オーストラ リア・ドル	ARENA REIT	45,981.00	172,888.56	
	BWP TRUST	66,965.00	259,824.20	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	104,758.00	182,278.92	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	84,443.00	259,240.01	
	CENTURIA OFFICE REIT	43,559.00	62,942.75	
	CHARTER HALL GROUP	73,143.00	833,098.77	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	97,225.00	420,984.25	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	91,686.00	350,240.52	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	37,955.00	115,003.65	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	218,718.00	127,950.03	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	30,237.00	85,570.71	
	DEXUS/AU	164,087.00	1,276,596.86	
	GDI PROPERTY GROUP	43,204.00	31,538.92	
	GOODMAN GROUP	261,832.00	5,066,449.20	
	GPT GROUP	286,000.00	1,275,560.00	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	62,361.00	200,178.81	
	HEALTHCO REIT	51,410.00	68,118.25	
	HMC CAPITAL LTD	33,678.00	132,354.54	
	HOMEKO DAILY NEEDS REIT	239,155.00	288,181.77	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	25,921.00	87,612.98	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	62,840.00	260,157.60	
	MIRVAC GROUP	634,643.00	1,453,332.47	
	NATIONAL STORAGE REIT	208,817.00	524,130.67	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	89,106.00	63,710.79	
	REGION RE LTD	191,819.00	471,874.74	
	RURAL FUNDS GROUP	52,739.00	103,895.83	
SCENTRE GROUP	801,211.00	2,291,463.46		
STOCKLAND	362,655.00	1,548,536.85		
VICINITY CENTRES	591,192.00	1,217,855.52		
WAYPOINT REIT	113,111.00	296,350.82		
オーストラリア・ドル小計		5,221,431.00	19,664,039.05 (1,744,396,903)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	373,000.00	1,219,710.00	
	FORTUNE REIT	259,000.00	1,675,730.00	
	LINK REIT	388,700.00	19,435,000.00	
	PROSPERITY REIT	178,000.00	345,320.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	110,000.00	341,000.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	293,000.00	600,650.00	
香港・ドル小計		1,601,700.00	23,617,410.00 (402,440,665)	
シンガポ ール・ドル	AIMS APAC REIT	113,300.00	152,955.00	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	515,700.00	1,454,274.00	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	318,755.00	341,067.85	
	CAPITALAND CHINA TRUST	205,700.00	232,441.00	

	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	778,808.00	1,604,344.48	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	159,550.00	196,246.50	
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	44,500.00	25,365.00	
	EC WORLD REIT	52,800.00	15,576.00	
	ESR-LOGOS REIT	864,913.00	281,096.72	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	190,000.00	116,850.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	176,400.00	45,864.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	166,800.00	386,976.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC I	433,738.00	563,859.40	
	KEPPEL DC REIT	200,100.00	420,210.00	
	KEPPEL REIT	275,800.00	246,841.00	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	262,000.00	184,710.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	324,500.00	772,310.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	495,150.00	861,561.00	
	MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	355,000.00	631,900.00	
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	502,900.00	165,957.00	
	PARAGON REIT	115,700.00	108,758.00	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	69,800.00	275,710.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	66,700.00	49,024.50	
	STARHILL GLOBAL REIT	138,200.00	73,246.00	
	SUNTEC REIT	324,800.00	464,464.00	
	シンガポール・ドル小計	7,151,614.00	9,671,607.45 (967,257,461)	
ニュージー ランド・ド ル	ARGOSY PROPERTY LTD	153,482.00	173,434.66	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	154,373.00	333,445.68	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	200,506.00	178,450.34	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	217,149.00	279,036.46	
	STRIDE PROPERTY GROUP	90,554.00	116,814.66	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	77,686.00	178,289.37	
	ニュージーランド・ドル小計	893,750.00	1,259,471.17 (103,515,934)	
イギリス・ ポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	53,280.00	29,197.44	
	AEW UK REIT PLC	9,000.00	8,811.00	
	ASSURA PLC	472,915.00	234,565.84	
	BALANCED COMM PROPERTY TRUST	154,750.00	125,347.50	
	BIG YELLOW GROUP PLC	26,200.00	308,374.00	
	BRITISH LAND CO PLC	150,571.00	577,289.21	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	108,964.00	59,712.27	
	CLS HOLDINGS PLC	41,598.00	53,744.61	
	CUSTODIAN PROPERTY INCOME RE	84,958.00	77,651.61	
	DERWENT LONDON PLC	16,800.00	401,856.00	
	EDISTON PROPERTY INVESTMENT	48,662.00	31,873.61	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	95,000.00	86,070.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	41,616.00	213,906.24	

	HAMMERSON PLC	591,835.00	160,979.12	
	HOME REIT PLC	96,051.00	36,499.38	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	88,651.00	85,193.61	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	116,859.00	752,571.96	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	141,905.00	261,956.63	
	LXI REIT PLC	247,814.00	254,009.35	
	NEWRIVER REIT PLC	46,021.00	37,507.11	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	57,141.00	42,855.75	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	182,000.00	188,916.00	
	PRS REIT PLC/THE	89,207.00	74,041.81	
	REGIONAL REIT LTD	45,664.00	24,521.56	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	31,848.00	298,734.24	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	70,698.00	32,945.26	
	SEGro PLC	190,440.00	1,532,661.12	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	269,308.00	309,165.58	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	187,422.00	157,996.74	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	34,770.00	16,272.36	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	288,959.00	428,237.23	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	117,847.00	60,809.05	
	UNITE GROUP PLC/THE	62,834.00	594,095.47	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	76,400.00	102,070.40	
	WAREHOUSE REIT PLC	72,100.00	76,281.80	
	WORKSPACE GROUP PLC	20,210.00	94,380.70	
	イギリス・ボンド小計	4,430,298.00	7,831,101.56 (1,299,806,237)	
イスラエル・シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	110,000.00	168,850.00	
	REIT 1 LTD	29,102.00	446,715.70	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	31,012.00	228,868.56	
	イスラエル・シュケル小計	170,114.00	844,434.26 (30,984,742)	
韓国・ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	6,350.00	20,859,750.00	
	E KOCREF CR-REIT CO LTD	8,422.00	41,941,560.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	24,000.00	89,520,000.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	4,067.00	19,074,230.00	
	JR REIT XXVII	19,000.00	82,460,000.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	6,226.00	31,441,300.00	
	LOTTE REIT CO LTD	20,121.00	73,240,440.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	9,815.00	39,799,825.00	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	12,561.00	42,142,155.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	8,762.00	50,293,880.00	
	SK REITS CO LTD	12,831.00	63,256,830.00	
	韓国・ウォン小計	132,155.00	554,029,970.00 (55,402,997)	
ユーロ	AEDIFICA	5,710.00	417,686.50	

ALSTRIA OFFICE REIT-AG	1,380.00	8,252.40	
ALTAREA	723.00	86,037.00	
CARE PROPERTY INVEST	7,476.00	97,636.56	
CARMILA	8,615.00	126,640.50	
COFINIMMO	4,682.00	394,692.60	
COVIVIO	7,454.00	369,718.40	
CROMWELL REIT EUR	48,320.00	74,896.00	
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	6,975.00	145,080.00	
GECINA SA	8,692.00	848,339.20	
HAMBORNER REIT AG	10,700.00	77,361.00	
ICADE	4,873.00	201,059.98	
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	7,889.00	22,641.43	
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	44,900.00	249,868.50	
INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	4,899.00	87,398.16	
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	62,588.00	62,588.00	
KLEPIERRE	29,107.00	633,368.32	
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	6,940.00	36,990.20	
MERCIALYS	11,000.00	97,020.00	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	52,906.00	411,079.62	
MONTEA NV	1,880.00	143,632.00	
NSI NV	2,966.00	61,692.80	
RETAIL ESTATES	2,065.00	136,290.00	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	16,472.00	799,221.44	
VASTNED RETAIL NV	2,919.00	58,817.85	
WAREHOUSES DE PAUW SCA	23,590.00	643,535.20	
WERELDHAVE NV	5,522.00	74,823.10	
XIOR STUDENT HOUSING NV	3,590.00	101,238.00	
ユーロ小計	394,833.00	6,467,604.76 (949,250,351)	
投資証券合計		25,711,873,581 (25,711,873,581)	
合計		25,711,873,581 (25,711,873,581)	

(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	75.4%	76.6%
カナダ・ドル	投資証券 29銘柄	1.8%	1.8%
オーストラリア・ドル	投資証券 31銘柄	6.7%	6.8%
香港・ドル	投資証券 6銘柄	1.5%	1.6%
シンガポール・ドル	投資証券 25銘柄	3.7%	3.8%
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	5.0%	5.1%
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 11銘柄	0.2%	0.2%

ユーロ	投資証券	28銘柄	3.6%	3.7%
-----	------	------	------	------

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2022年4月26日現在)	(2023年4月26日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	1,420,250,939	2,185,437,246
金銭信託	35,129,306	2,359,458
コール・ローン	1,771,896,597	105,859,147
株式	13,549,402,847	23,393,522,044
投資信託受益証券	752,699,820	1,407,985,442
投資証券	1,401,586,708	2,245,684,067
派生商品評価勘定	245,941,843	7,567,059
未収入金	121,741	112,304
未収配当金	31,232,619	26,923,620
差入委託証拠金	844,604,732	500,135,192
流動資産合計	20,052,867,152	29,875,585,579
資産合計	20,052,867,152	29,875,585,579
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	62,722,219	21,435,746
未払解約金	22,441,148	7,697,534
その他未払費用	4,032	286
流動負債合計	85,167,399	29,133,566
負債合計	85,167,399	29,133,566
純資産の部		
元本等		
元本	12,191,357,761	18,515,218,766
剰余金		
剰余金又は欠損金()	7,776,341,992	11,331,233,247
元本等合計	19,967,699,753	29,846,452,013
純資産合計	19,967,699,753	29,846,452,013
負債純資産合計	20,052,867,152	29,875,585,579

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年4月27日 至 2023年4月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、投資信託受益証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。

	<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>

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	（2022年4月26日現在）	（2023年4月26日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	12,191,357,761口	18,515,218,766口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.6379円 （1万口当たりの純資産額16,379円）	1口当たり純資産額 1.6120円 （1万口当たりの純資産額16,120円）

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年4月27日 至 2023年4月26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</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、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
<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>

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年4月26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ぬ。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（株式、投資信託受益証券、投資証券）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>

	(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4月26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 JUN22	4,275,648,872	-	4,259,752,464	15,896,408
	小計	4,275,648,872	-	4,259,752,464	15,896,408
合計		4,275,648,872	-	4,259,752,464	15,896,408

(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	2,737,900,000	-	2,974,595,381	236,695,381
	小計	2,737,900,000	-	2,974,595,381	236,695,381
	売建				
	アメリカ・ドル	952,000,000	-	989,579,349	37,579,349
	小計	952,000,000	-	989,579,349	37,579,349
合計		3,689,900,000	-	3,964,174,730	199,116,032

(2023年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MSCI EMGMKT JUN23	2,813,823,366	-	2,800,166,400	13,656,966
	小計	2,813,823,366	-	2,800,166,400	13,656,966
合計		2,813,823,366	-	2,800,166,400	13,656,966

(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	54,600,000	-	54,388,279	211,721
	小計	54,600,000	-	54,388,279	211,721
	合 計	54,600,000	-	54,388,279	211,721

(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。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2022年4月27日 至 2023年4月26日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2022年4月26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	8,325,755,557円
同期中における追加設定元本額	6,016,733,591円
同期中における一部解約元本額	2,151,131,387円

2022年4月26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	6,746,739,785円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	2,714,636,324円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	44,385,580円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	237,701,767円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	157,541,199円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	28,182,083円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	90,118,390円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	65,071,224円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	259,245,317円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	214,464,764円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	348,547,103円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	78,602,899円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	3,563,961円
日興FWS・新興国株インデックス（為替ヘッジあり）	430,155,490円
日興FWS・新興国株インデックス（為替ヘッジなし）	711,584,443円
三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド	5,814,304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>	55,003,128円
合計	12,191,357,761円

(2023年4月26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	12,191,357,761円
同期中における追加設定元本額	7,866,881,112円
同期中における一部解約元本額	1,543,020,107円

2023年4月26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	9,603,795,290円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	3,137,437,890円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	266,639,650円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	341,756,222円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	213,735,906円
イオン・バランス戦略ファンド	138,659,796円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	45,616,597円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	107,677,981円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	81,183,599円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	361,015,086円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	296,699,876円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	492,667,030円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	112,507,484円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	5,709,321円
日興FWS・新興国株インデックス（為替ヘッジあり）	862,226,104円
日興FWS・新興国株インデックス（為替ヘッジなし）	2,310,859,323円
三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド	57,707,897円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	39,354円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	47,702円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	59,639円

三井住友D S ・ D Cターゲットイヤーファンド2055	73,424円
三井住友D S ・ D Cターゲットイヤーファンド2065	73,424円
三井住友D S ・ F W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 ・ F W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 ・ F W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>	78,786,726円
合 計	18,515,218,766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	33,500	1.473	49,345.50	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	6,013	7.450	44,796.85	
	SOUTHERN COPPER CORP	2,684	75.590	202,883.56	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	13,335	27.460	366,179.10	
	NIO INC - ADR	43,231	7.900	341,524.90	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	6,094	44.970	274,047.18	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	14,239	5.840	83,155.76	
	TRIP.COM GROUP LTD-ADR	17,506	35.110	614,635.66	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	13,362	60.120	803,323.44	
	MINISO GROUP HOLDING LTD-ADR	2,998	16.220	48,627.56	
	PDD HOLDINGS INC	16,082	64.580	1,038,575.56	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	12,550	14.010	175,825.50	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	1,849	68.600	126,841.40	
	ZAI LAB LTD-ADR	2,781	34.740	96,611.94	
	CREDICORP LTD	2,259	134.430	303,677.37	
	360 DIGITECH INC	3,764	16.240	61,127.36	
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	18,837	1.730	32,588.01	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	15,830	3.438	54,423.54	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	1,673	42.460	71,035.58	
	AUTOHOME INC-ADR	2,090	28.530	59,627.70	
	IQIYI INC-ADR	13,729	5.910	81,138.39	
	JOYY INC-ADR	1,164	27.220	31,684.08	
	KANZHUN LTD - ADR	6,243	16.560	103,384.08	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	22,466	7.000	157,262.00	
WEIBO CORP-SPON ADR	2,729	15.970	43,582.13		
KE HOLDINGS INC-ADR	21,034	15.810	332,547.54		
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	36,680	0.750	27,510.00		
アメリカ・ドル小計		334,722		5,625,961.69 (752,753,674)	

香港・ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	51,000	6.540	333,540.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	50,000	9.000	450,000.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	804,000	5.100	4,100,400.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	110,000	25.150	2,766,500.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	666,000	5.330	3,549,780.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	48,000	26.050	1,250,400.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	110,000	4.440	488,400.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	39,000	25.200	982,800.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	65,000	7.830	508,950.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	122,000	5.840	712,480.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	78,000	3.560	277,680.00	
	CMOC GROUP LTD-H	99,000	5.050	499,950.00	
	DONGYUE GROUP	43,000	7.600	326,800.00	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO L-H	10,200	48.500	494,700.00	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	31,000	13.940	432,140.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	37,000	5.550	205,350.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	25,000	16.560	414,000.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	33,000	12.540	413,820.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	186,000	13.040	2,425,440.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	99,000	4.040	399,960.00	
	BOC AVIATION LTD	6,100	60.900	371,490.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	54,000	4.110	221,940.00	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	56,500	12.420	701,730.00	
	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	23,000	6.560	150,880.00	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	152,000	5.820	884,640.00	
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	64,000	9.500	608,000.00	
	CITIC LTD	193,000	9.460	1,825,780.00	
	CRRC CORP LTD - H	144,000	4.970	715,680.00	
	FOSUN INTERNATIONAL LTD	72,000	5.310	382,320.00	
	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	21,000	20.050	421,050.00	
	SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	39,000	9.340	364,260.00	
	WEICHAI POWER CO LTD-H	68,000	11.300	768,400.00	
	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	19,400	31.100	603,340.00	
	CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	123,000	3.150	387,450.00	
	AIR CHINA LTD-H	56,000	6.880	385,280.00	
	BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	44,000	5.850	257,400.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	38,140	11.540	440,135.60		
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	72,000	5.270	379,440.00		
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	100,400	9.350	938,740.00		
COSCO SHIPPING PORTS LTD	74,000	4.820	356,680.00		
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	50,000	7.700	385,000.00		
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	4,000	161.700	646,800.00		
SHENZHEN INTL HOLDINGS	49,500	7.090	350,955.00		
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	32,000	6.530	208,960.00		

BYD CO LTD-H	26,500	223.000	5,909,500.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	70,000	3.560	249,200.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	16,800	31.150	523,320.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	190,000	9.570	1,818,300.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	94,500	9.060	856,170.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	81,200	4.700	381,640.00	
LI AUTO INC-CLASS A	36,300	88.250	3,203,475.00	
MINTH GROUP LTD	22,000	22.000	484,000.00	
XPENG INC - CLASS A SHARES	29,200	35.950	1,049,740.00	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	34,000	17.780	604,520.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	39,400	96.000	3,782,400.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	104,000	3.830	398,320.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	72,600	23.800	1,727,880.00	
LI NING CO LTD	75,500	55.450	4,186,475.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	26,100	74.050	1,932,705.00	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	33,000	9.020	297,660.00	
EAST BUY HOLDING LTD	13,000	29.050	377,650.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	31,000	18.320	567,920.00	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	23,000	16.720	384,560.00	
MEITUAN-CLASS B	158,760	131.600	20,892,816.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	45,900	34.100	1,565,190.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	38,400	16.440	631,296.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	29,000	14.780	428,620.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	468,600	84.100	39,409,260.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	22,000	12.240	269,280.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	2,300	170.000	391,000.00	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	68,200	15.180	1,035,276.00	
JD.COM INC - CL A	68,685	132.700	9,114,499.50	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	21,000	17.560	368,760.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	49,000	7.020	343,980.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	21,000	32.750	687,750.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	144,000	5.560	800,640.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	35,150	54.600	1,919,190.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	13,500	18.980	256,230.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	3,400	138.200	469,880.00	
CHINA FEIHE LTD	127,000	5.260	668,020.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	100,000	30.950	3,095,000.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	52,000	59.700	3,104,400.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	51,000	3.260	166,260.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	57,400	41.850	2,402,190.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	58,000	9.010	522,580.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	60,000	13.640	818,400.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	20,000	81.000	1,620,000.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	28,000	7.720	216,160.00	

WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	166,000	5.030	834,980.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	16,000	19.740	315,840.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	18,000	36.750	661,500.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	9,000	21.550	193,950.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	10,800	54.550	589,140.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	23,700	17.580	416,646.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	78,400	13.160	1,031,744.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	24,700	15.420	380,874.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	42,400	26.850	1,138,440.00	
3SBIO INC	46,000	7.770	357,420.00	
AKESO INC	15,000	41.100	616,500.00	
BEIGENE LTD	20,100	150.700	3,029,070.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	44,000	13.020	572,880.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	54,500	6.760	368,420.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	86,000	4.160	357,760.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	282,800	7.720	2,183,216.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	36,000	19.840	714,240.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	3,900	69.900	272,610.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	34,000	14.100	479,400.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	36,000	37.350	1,344,600.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	5,100	31.650	161,415.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	16,500	21.800	359,700.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	327,000	4.210	1,376,670.00	
WUXI APPTTEC CO LTD-H	11,211	68.650	769,635.15	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	114,500	46.300	5,301,350.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	922,000	3.020	2,784,440.00	
BANK OF CHINA LTD-H	2,534,000	3.140	7,956,760.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	276,000	5.070	1,399,320.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	303,000	4.290	1,299,870.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	3,051,000	5.240	15,987,240.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	77,000	2.480	190,960.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	125,000	39.500	4,937,500.00	
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	174,100	2.850	496,185.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	1,801,000	4.210	7,582,210.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	251,000	5.130	1,287,630.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	188,000	0.910	171,080.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	86,500	4.090	353,785.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	42,400	16.160	685,184.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	71,000	16.360	1,161,560.00	
FAR EAST HORIZON LTD	42,000	7.000	294,000.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	27,200	11.020	299,744.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	80,800	5.120	413,696.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	43,200	10.060	434,592.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	241,000	14.260	3,436,660.00	

CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	83,200	23.200	1,930,240.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	35,400	8.710	308,334.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	31,800	20.700	658,260.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	231,000	2.880	665,280.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	218,000	9.080	1,979,440.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	200,000	51.450	10,290,000.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	19,800	23.900	473,220.00	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	100,000	5.130	513,000.00	
GDS HOLDINGS LTD-CL A	23,900	14.980	358,022.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	82,000	11.420	936,440.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	20,000	16.100	322,000.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	19,000	21.650	411,350.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	18,500	23.050	426,425.00	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	21,000	7.950	166,950.00	
LENOVO GROUP LTD	240,000	8.010	1,922,400.00	
SUNNY OPTICAL TECH	22,500	81.650	1,837,125.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	480,600	10.940	5,257,764.00	
ZTE CORP-H	23,800	25.500	606,900.00	
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	9,000	20.750	186,750.00	
GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	642,000	1.950	1,251,900.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	19,000	35.250	669,750.00	
SHANGHAI FUDAN MICROELECT-H	8,000	23.750	190,000.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	154,000	7.980	1,228,920.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	1,400,000	0.970	1,358,000.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	17,000	30.800	523,600.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	100,000	1.890	189,000.00	
CGN POWER CO LTD-H	333,000	1.940	646,020.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	94,400	9.850	929,840.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	105,000	8.320	873,600.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	148,000	2.910	430,680.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	29,200	25.500	744,600.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	60,000	16.480	988,800.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	25,700	105.600	2,713,920.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	92,000	7.660	704,720.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	114,000	4.480	510,720.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	122,000	6.700	817,400.00	
BAIDU INC-CLASS A	70,200	117.400	8,241,480.00	
BILIBILI INC-CLASS Z	5,980	153.300	916,734.00	
CHINA LITERATURE LTD	12,200	35.350	431,270.00	
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	172,000	1.830	314,760.00	
KINGSOFT CORP LTD	26,600	33.600	893,760.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	55,800	48.100	2,683,980.00	
NETEASE INC	62,200	138.500	8,614,700.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	196,800	338.400	66,597,120.00	

	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	21,000	23.600	495,600.00	
	CHINA EVERGRANDE GROUP	66,000	1.480	97,680.00	
	CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	160,000	1.470	235,200.00	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	121,000	19.440	2,352,240.00	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	50,000	8.250	412,500.00	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	102,000	35.700	3,641,400.00	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	23,400	40.650	951,210.00	
	CHINA VANKE CO LTD-H	47,800	11.980	572,644.00	
	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	392,000	2.020	791,840.00	
	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	74,000	12.540	927,960.00	
	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	22,500	9.450	212,625.00	
	GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	34,000	4.860	165,240.00	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	63,000	21.550	1,357,650.00	
	SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	18,500	3.940	72,890.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	38,600	10.580	408,388.00	
	香港・ドル小計	26,057,826		374,132,210.25 (6,375,212,863)	
台湾・ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	32,000	85.200	2,726,400.00	
	ASIA CEMENT CORP	73,000	43.950	3,208,350.00	
	CHINA STEEL CORP	382,000	29.750	11,364,500.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	111,000	68.800	7,636,800.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	134,000	92.000	12,328,000.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	154,000	77.400	11,919,600.00	
	TAIWAN CEMENT	191,676	38.500	7,379,526.00	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	5,000	1,080.000	5,400,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	111,000	31.750	3,524,250.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	2,000	1,755.000	3,510,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	78,000	48.600	3,790,800.00	
	CHINA AIRLINES LTD	106,000	18.800	1,992,800.00	
	EVA AIRWAYS CORP	91,000	25.650	2,334,150.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	30,096	162.000	4,875,552.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	64,000	30.750	1,968,000.00	
	WAN HAI LINES LTD	25,605	64.200	1,643,841.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	55,000	63.700	3,503,500.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	44,000	36.950	1,625,800.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	6,000	477.500	2,865,000.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	13,640	188.500	2,571,140.00	
	GIANT MANUFACTURING	10,000	181.000	1,810,000.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	6,000	326.000	1,956,000.00	
	POU CHEN	70,000	31.500	2,205,000.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	9,000	640.000	5,760,000.00	
	MOMO.COM INC	2,200	804.000	1,768,800.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	17,000	271.000	4,607,000.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	152,000	73.000	11,096,000.00	

PHARMAESSENTIA CORP	6,000	369.000	2,214,000.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	132,741	17.500	2,322,967.50	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	567,000	22.350	12,672,450.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	405,669	24.950	10,121,441.55	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	345,147	26.900	9,284,454.30	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	292,970	22.800	6,679,716.00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	360,700	33.900	12,227,730.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	340,737	16.650	5,673,271.05	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	339,647	17.100	5,807,963.70	
TAIWAN BUSINESS BANK	168,000	13.850	2,326,800.00	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	309,108	26.550	8,206,817.40	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	121,299	46.500	5,640,403.50	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	44,836	222.000	9,953,592.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	315,284	22.400	7,062,361.60	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	277,000	42.600	11,800,200.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	452,196	12.950	5,855,938.20	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	239,950	57.500	13,797,125.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	414,432	8.400	3,481,228.80	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	15,000	287.500	4,312,500.00	
ACER INC	81,000	29.000	2,349,000.00	
ADVANTECH CO LTD	14,299	358.000	5,119,042.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	23,000	278.000	6,394,000.00	
AUO CORP	222,600	17.950	3,995,670.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	18,000	179.000	3,222,000.00	
COMPAL ELECTRONICS	129,000	23.700	3,057,300.00	
DELTA ELECTRONICS INC	61,000	297.000	18,117,000.00	
E INK HOLDINGS INC	27,000	170.000	4,590,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	393,800	103.000	40,561,400.00	
INNOLUX CORP	307,540	13.850	4,259,429.00	
INVENTEC CORP	72,000	31.700	2,282,400.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	3,480	2,010.000	6,994,800.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	60,000	71.800	4,308,000.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	21,000	141.000	2,961,000.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	6,000	258.000	1,548,000.00	
PEGATRON CORP	68,000	69.000	4,692,000.00	
QUANTA COMPUTER INC	85,000	83.700	7,114,500.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	37,000	60.700	2,245,900.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	37,000	135.000	4,995,000.00	
WIWYNN CORP	3,000	1,085.000	3,255,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	44,520	49.800	2,217,096.00	
YAGEO CORPORATION	11,912	490.500	5,842,836.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	19,000	109.000	2,071,000.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	103,000	101.500	10,454,500.00	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	2,000	1,815.000	3,630,000.00	

	GLOBALWAFERS CO LTD	7,000	478.500	3,349,500.00	
	MEDIATEK INC	48,000	650.000	31,200,000.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	35,000	63.500	2,222,500.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	19,000	409.000	7,771,000.00	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	2,000	968.000	1,936,000.00	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	103,000	30.000	3,090,000.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	14,000	344.500	4,823,000.00	
	SILERGY CORP	10,800	453.000	4,892,400.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	778,000	498.000	387,444,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	374,000	48.500	18,139,000.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	25,000	87.000	2,175,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	9,000	165.000	1,485,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	83,000	24.600	2,041,800.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	123,000	126.000	15,498,000.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	45,000	78.000	3,510,000.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	54,000	103.000	5,562,000.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	48,270	35.400	1,708,758.00	
	台湾・ドル小計	10,751,154		917,936,600.60 (3,995,686,229)	
エジプト・ ポンド	EASTERN CO SAE	13,558	17.010	230,621.58	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BAN	74,092	53.600	3,971,331.20	
	EFG-HERMES HOLDING SAE	15,925	17.580	279,961.50	
	エジプト・ポンド小計	103,575		4,481,914.28 (19,386,967)	
トルコ・リ ラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	32,627	72.000	2,349,144.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	38,881	34.160	1,328,174.96	
	HEKTAS TICARET T.A.S	31,731	28.900	917,025.90	
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	37,677	21.040	792,724.08	
	SASA POLYESTER SANAYI	12,486	105.200	1,313,527.20	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	19,291	49.900	962,620.90	
	KOC HOLDING AS	23,228	78.800	1,830,366.40	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	39,792	40.760	1,621,921.92	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	1,852	471.000	872,292.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	18,832	133.700	2,517,838.40	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	2,571	566.600	1,456,728.60	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	15,813	152.300	2,408,319.90	
	AKBANK T.A.S.	86,995	17.250	1,500,663.75	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	27,103	40.080	1,086,288.24	
	TURKIYE IS BANKASI-C	128,081	11.430	1,463,965.83	
	YAPI VE KREDI BANKASI	82,399	9.900	815,750.10	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	33,738	35.440	1,195,674.72		
	トルコ・リラ小計	633,097		24,433,026.90 (168,265,370)	
メキシコ・ ペソ	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	100,600	88.790	8,932,274.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	4,395	285.000	1,252,575.00	

	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	28,000	40.030	1,120,840.00	
	ALFA S.A.B. -A	83,900	11.420	958,138.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	14,200	100.270	1,423,834.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	11,300	312.800	3,534,640.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	5,775	508.210	2,934,912.75	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	7,195	186.100	1,338,989.50	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	165,300	72.440	11,974,332.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	15,000	167.940	2,519,100.00	
	GRUMA S.A.B. -B	6,425	263.920	1,695,686.00	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	42,000	92.470	3,883,740.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	47,400	40.680	1,928,232.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	21,600	59.930	1,294,488.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	82,400	156.780	12,918,672.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	67,700	40.390	2,734,403.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER B	879,000	19.050	16,744,950.00	
	OPERADORA DE SITES MEX- A-1	30,400	17.070	518,928.00	
	メキシコ・ペソ小計	1,612,590		77,708,734.25 (575,922,742)	
フィリピン・ペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	42,090	53.200	2,239,188.00	
	AYALA CORPORATION	8,660	648.000	5,611,680.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	82,562	49.900	4,119,843.80	
	SM INVESTMENTS CORP	7,245	900.000	6,520,500.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	30,770	218.000	6,707,860.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	12,830	220.000	2,822,600.00	
	MONDE NISSIN CORP	155,700	9.600	1,494,720.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	27,990	146.000	4,086,540.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	67,903	109.500	7,435,378.50	
	BDO UNIBANK INC	74,754	139.700	10,443,133.80	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	58,720	60.000	3,523,200.00	
	PLDT INC	2,690	1,230.000	3,308,700.00	
	ACEN CORP	13,980	6.100	85,278.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	10,060	323.200	3,251,392.00	
	AYALA LAND INC	252,400	26.350	6,650,740.00	
SM PRIME HOLDINGS INC	380,300	33.700	12,816,110.00		
	フィリピン・ペソ小計	1,228,654		81,116,864.10 (195,410,526)	
チリ・ペソ	EMPRESAS COPEC SA	10,529	5,585.400	58,808,676.60	
	EMPRESAS CMPC SA	36,662	1,299.000	47,623,938.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	4,603	54,100.000	249,022,300.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	374,056	83.600	31,271,081.60	
	FALABELLA SA	28,182	1,769.000	49,853,958.00	
	CENCOSUD SA	40,071	1,610.000	64,514,310.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	5,381	6,400.000	34,438,400.00	
	BANCO DE CHILE	1,530,852	79.920	122,345,691.84	

	BANCO DE CREDITO E INVERSION	1,970	23,300.000	45,901,000.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	1,825,075	36.320	66,286,724.00	
	ENEL AMERICAS SA	600,505	108.970	65,437,029.85	
	ENEL CHILE SA	971,320	44.160	42,893,491.20	
	チリ・ペソ小計	5,429,206		878,396,601.09 (144,637,663)	
コロンビア・ペソ	BANCOLOMBIA SA	5,994	38,300.000	229,570,200.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	12,217	30,420.000	371,641,140.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	14,643	17,700.000	259,181,100.00	
	コロンビア・ペソ小計	32,854		860,392,440.00 (25,512,357)	
インド・ルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	25,859	347.500	8,986,002.50	
	COAL INDIA LTD	52,468	230.250	12,080,757.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	15,734	247.000	3,886,298.00	
	INDIAN OIL CORP LTD	89,126	78.450	6,991,934.70	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	79,406	160.650	12,756,573.90	
	PETRONET LNG LTD	27,436	236.900	6,499,588.40	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	96,432	2,376.050	229,127,253.60	
	ACC LTD	2,094	1,736.150	3,635,498.10	
	AMBUJA CEMENTS LTD	16,248	382.500	6,214,860.00	
	ASIAN PAINTS LTD	12,104	2,898.000	35,077,392.00	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	6,933	594.050	4,118,548.65	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	8,842	1,686.850	14,915,127.70	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	42,552	429.800	18,288,849.60	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	11,377	575.650	6,549,170.05	
	JSW STEEL LTD	22,886	725.000	16,592,350.00	
	PI INDUSTRIES LTD	2,663	3,098.100	8,250,240.30	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	4,812	2,411.350	11,603,416.20	
	SHREE CEMENT LTD	375	24,078.400	9,029,400.00	
	SRF LTD	5,058	2,491.950	12,604,283.10	
	TATA STEEL LTD	238,942	107.050	25,578,741.10	
	ULTRATECH CEMENT LTD	3,189	7,439.200	23,723,608.80	
	UPL LTD	15,397	714.650	11,003,466.05	
	VEDANTA LTD	20,729	278.700	5,777,172.30	
	ABB INDIA LTD	1,540	3,336.100	5,137,594.00	
	ADANI ENTERPRISES LTD	6,049	1,844.600	11,157,985.40	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	108,550	101.150	10,979,832.50	
	CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	19,270	306.150	5,899,510.50	
	HAVELLS INDIA LTD	7,562	1,215.900	9,194,635.80	
	LARSEN & TOUBRO LTD	21,733	2,247.950	48,854,697.35	
	SIEMENS LTD	2,242	3,331.350	7,468,886.70	
	INDIAN RAILWAY CATERING & TO	6,819	607.900	4,145,270.10	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	15,526	671.450	10,424,932.70		
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	10,064	604.350	6,082,178.40		

INTERGLOBE AVIATION LTD	3,058	1,992.700	6,093,676.60	
BAJAJ AUTO LTD	2,042	4,342.550	8,867,487.10	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	1,906	2,040.250	3,888,716.50	
BHARAT FORGE LTD	7,140	784.300	5,599,902.00	
EICHER MOTORS LTD	4,315	3,217.950	13,885,454.25	
HERO MOTOCORP LTD	3,316	2,497.750	8,282,539.00	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	27,464	1,209.850	33,227,320.40	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	3,911	8,468.900	33,121,867.90	
MRF LTD	70	86,561.450	6,059,301.50	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	74,623	71.150	5,309,426.45	
TATA MOTORS LTD	52,409	473.550	24,818,281.95	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	2,959	2,504.950	7,412,147.05	
TVS MOTOR CO LTD	5,958	1,111.500	6,622,317.00	
PAGE INDUSTRIES LTD	194	40,651.950	7,886,478.30	
TITAN CO LTD	11,207	2,633.200	29,510,272.40	
INDIAN HOTELS CO LTD	23,753	338.850	8,048,704.05	
JUBILANT FOODWORKS LTD	14,355	450.100	6,461,185.50	
ZOMATO LTD	83,422	57.750	4,817,620.50	
TRENT LTD	5,541	1,381.300	7,653,783.30	
AVENUE SUPERMARTS LTD	5,111	3,465.850	17,713,959.35	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	3,421	4,402.550	15,061,123.55	
ITC LTD	94,848	411.550	39,034,694.40	
MARICO LTD	18,008	489.750	8,819,418.00	
NESTLE INDIA LTD	1,065	20,665.200	22,008,438.00	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	18,760	734.450	13,778,282.00	
UNITED SPIRITS LTD	10,302	771.150	7,944,387.30	
VARUN BEVERAGES LTD	6,566	1,437.250	9,436,983.50	
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	3,413	1,567.150	5,348,682.95	
DABUR INDIA LTD	21,140	526.400	11,128,096.00	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	12,910	963.200	12,434,912.00	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	26,290	2,490.450	65,473,930.50	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	2,956	4,416.500	13,055,174.00	
AUROBINDO PHARMA LTD	6,499	600.500	3,902,649.50	
CIPLA LTD	14,137	909.650	12,859,722.05	
DIVI'S LABORATORIES LTD	3,911	3,226.450	12,618,645.95	
DR. REDDY'S LABORATORIES	3,867	4,833.300	18,690,371.10	
LUPIN LTD	4,861	705.500	3,429,435.50	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	30,288	972.500	29,455,080.00	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	2,503	1,642.300	4,110,676.90	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	6,667	660.150	4,401,220.05	
AXIS BANK LTD	72,768	878.350	63,915,772.80	
BANDHAN BANK LTD	17,965	223.400	4,013,381.00	
BANK OF BARODA	38,009	184.100	6,997,456.90	
ICICI BANK LTD	163,823	913.450	149,644,119.35	

	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	18,038	1,889.300	34,079,193.40	
	STATE BANK OF INDIA	57,923	561.800	32,541,141.40	
	YES BANK LTD	362,942	15.550	5,643,748.10	
	BAJAJ FINANCE LTD	8,598	6,075.250	52,234,999.50	
	BAJAJ FINSERV LTD	12,064	1,345.800	16,235,731.20	
	BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	859	6,495.350	5,579,505.65	
	CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	14,064	838.550	11,793,367.20	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	54,870	2,757.000	151,276,590.00	
	MUTHOOT FINANCE LTD	2,968	1,016.450	3,016,823.60	
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	6,575	772.650	5,080,173.75	
	SHRIRAM FINANCE LTD	6,781	1,432.750	9,715,477.75	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	30,521	529.750	16,168,499.75	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	7,594	1,073.750	8,154,057.50	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	10,024	434.550	4,355,929.20	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	14,213	1,105.850	15,717,446.05	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	30,267	1,053.450	31,884,771.15	
	INFOSYS LTD	106,790	1,224.900	130,807,071.00	
	LTIMINDTREE LTD	2,801	4,186.400	11,726,106.40	
	MPHASIS LTD	2,360	1,759.800	4,153,128.00	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	28,870	3,176.000	91,691,120.00	
	TATA ELXSI LTD	1,081	6,271.200	6,779,167.20	
	TECH MAHINDRA LTD	18,434	997.000	18,378,698.00	
	WIPRO LTD	43,286	375.650	16,260,385.90	
	BHARTI AIRTEL LTD	70,229	772.600	54,258,925.40	
	INDUS TOWERS LTD	16,890	138.000	2,330,820.00	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	9,184	931.150	8,551,681.60	
	ADANI POWER LTD	19,015	205.650	3,910,434.75	
	ADANI TOTAL GAS LTD	7,863	935.250	7,353,870.75	
	ADANI TRANSMISSION LTD	8,032	1,012.950	8,136,014.40	
	GAIL INDIA LTD	71,754	109.200	7,835,536.80	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	11,856	494.700	5,865,163.20	
	NTPC LTD	127,228	171.100	21,768,710.80	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	99,065	232.900	23,072,238.50	
	TATA POWER CO LTD	43,262	197.650	8,550,734.30	
	INFO EDGE INDIA LTD	2,239	3,667.200	8,210,860.80	
	DLF LTD	21,945	410.150	9,000,741.75	
	GODREJ PROPERTIES LTD	3,083	1,291.500	3,981,694.50	
	インド・ルピー小計	3,271,316		2,251,579,709.15 (3,692,590,723)	
インドネシ ア・ルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBK P	454,200	3,000.000	1,362,600,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	46,800	31,075.000	1,454,310,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	303,800	2,100.000	637,980,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	891,211	800.000	712,968,800.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	90,200	7,500.000	676,500,000.00	

	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	380,461	4,020.000	1,529,453,220.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	91,200	6,025.000	549,480,000.00	
	VALE INDONESIA TBK	52,100	6,600.000	343,860,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	638,800	6,425.000	4,104,290,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	524,200	2,720.000	1,425,824,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	260,300	4,440.000	1,155,732,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	71,100	10,200.000	725,220,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	143,900	6,350.000	913,765,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	240,800	4,090.000	984,872,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	665,700	2,060.000	1,371,342,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,768,300	9,125.000	16,135,737,500.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	1,178,200	5,175.000	6,097,185,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	249,100	9,475.000	2,360,222,500.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	2,152,400	4,950.000	10,654,380,000.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	516,500	995.000	513,917,500.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	1,571,700	4,270.000	6,711,159,000.00	
	インドネシア・ルピア小計	12,290,972		60,420,798,520.00 (543,787,187)	
ブラジル・ リアル	COSAN SA	33,988	15.160	515,258.08	
	PETRO RIO SA	22,300	34.650	772,695.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	117,900	30.120	3,551,148.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	152,300	27.090	4,125,807.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	26,800	14.470	387,796.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	20,900	13.690	286,121.00	
	GERDAU SA-PREF	36,540	24.260	886,460.40	
	SUZANO SA	23,615	38.800	916,262.00	
	VALE SA	120,688	70.000	8,448,160.00	
	WEG SA	52,960	40.540	2,146,998.40	
	CCR SA	32,700	13.110	428,697.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	24,430	56.200	1,372,966.00	
	LOCALIZA RENT A CAR SA	109	15.640	1,704.76	
	RUMO SA	41,000	19.700	807,700.00	
	LOJAS RENNER S.A.	29,658	14.770	438,048.66	
	MAGAZINE LUIZA SA	110,400	3.280	362,112.00	
	VIBRA ENERGIA SA	40,280	13.330	536,932.40	
	ATACADA0 SA	19,900	10.600	210,940.00	
	RAIA DROGASIL SA	32,000	25.990	831,680.00	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	29,800	12.480	371,904.00	
	AMBEV SA	149,100	14.290	2,130,639.00	
	JBS SA	23,700	16.850	399,345.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	28,400	10.520	298,768.00	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	138,619	2.560	354,864.64		
REDE D'OR SAO LUIZ SA	20,200	22.820	460,964.00		
HYPERA SA	13,000	35.810	465,530.00		

	BANCO BRADESCO S.A.	48,281	12.310	594,339.11	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	168,336	13.700	2,306,203.20	
	BANCO DO BRASIL S.A.	27,100	43.020	1,165,842.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	152,900	25.600	3,914,240.00	
	ITAUSA SA	161,005	8.590	1,383,032.95	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	192,500	11.800	2,271,500.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	21,100	34.750	733,225.00	
	TOTVS SA	18,400	25.630	471,592.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	17,200	40.390	694,708.00	
	TIM SA	23,600	13.800	325,680.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	39,305	34.220	1,345,017.10	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	8,000	38.170	305,360.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	43,899	12.480	547,859.52	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	10,800	48.790	526,932.00	
	CPFL ENERGIA SA	7,300	33.890	247,397.00	
	ENEVA SA	32,200	11.200	360,640.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	6,450	41.120	265,224.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	30,100	27.610	831,061.00	
	ブラジル・リアル小計	2,349,763		49,799,354.22 (1,318,084,328)	
チェコ・コ ルナ	KOMERCNI BANKA AS	2,214	758.000	1,678,212.00	
	MONETA MONEY BANK AS	12,093	84.500	1,021,858.50	
	CEZ AS	5,093	1,154.000	5,877,322.00	
	チェコ・コルナ小計	19,400		8,577,392.50 (53,554,666)	
韓国・ウォ ン	HD HYUNDAI	1,340	59,400.000	79,596,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	1,839	175,100.000	322,008,900.00	
	S-OIL CORP	1,213	77,000.000	93,401,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	2,875	55,100.000	158,412,500.00	
	HYUNDAI STEEL CO	2,767	36,550.000	101,133,850.00	
	KOREA ZINC CO LTD	305	524,000.000	159,820,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	531	136,500.000	72,481,500.00	
	LG CHEM LTD	1,574	742,000.000	1,167,908,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	227	369,000.000	83,763,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	723	169,200.000	122,331,600.00	
	POSCO FUTURE M CO LTD	916	347,500.000	318,310,000.00	
	POSCO HOLDINGS INC	2,310	379,500.000	876,645,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	526	76,900.000	40,449,400.00	
	SKC CO LTD	496	101,700.000	50,443,200.00	
	CJ CORP	498	92,200.000	45,915,600.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	1,293	47,350.000	61,223,550.00	
	DOOSAN ENERBILITY CO LTD	12,273	18,100.000	222,141,300.00	
	ECOPRO BM CO LTD	1,543	253,500.000	391,150,500.00	
GS HOLDINGS	1,178	39,350.000	46,354,300.00		

HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	448	109,800.000	49,190,400.00	
HD KOREA SHIPBUILDING & OFFS	1,158	85,800.000	99,356,400.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	2,816	40,950.000	115,315,200.00	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	668	73,700.000	49,231,600.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	2,283	59,500.000	135,838,500.00	
LG CORP	2,979	86,400.000	257,385,600.00	
LG ENERGY SOLUTION	1,108	551,000.000	610,508,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	2,774	105,900.000	293,766,600.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	4,316	29,800.000	128,616,800.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	21,785	5,680.000	123,738,800.00	
SK INC	1,219	163,100.000	198,818,900.00	
S-1 CORPORATION	659	57,200.000	37,694,800.00	
HMM CO LTD	9,075	20,800.000	188,760,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	524	168,100.000	88,084,400.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	6,388	22,700.000	145,007,600.00	
PAN OCEAN CO LTD	10,467	5,790.000	60,603,930.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	2,114	34,550.000	73,038,700.00	
HANON SYSTEMS	4,138	9,260.000	38,317,880.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	1,996	237,500.000	474,050,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	4,460	201,000.000	896,460,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	1,296	105,000.000	136,080,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	582	100,800.000	58,665,600.00	
KIA CORP	8,315	86,600.000	720,079,000.00	
COWAY CO LTD	1,996	50,600.000	100,997,600.00	
F&F CO LTD / NEW	502	138,000.000	69,276,000.00	
LG ELECTRONICS INC	3,476	108,900.000	378,536,400.00	
KANGWON LAND INC	3,691	18,930.000	69,870,630.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	1,159	77,700.000	90,054,300.00	
LOTTE SHOPPING CO	172	80,400.000	13,828,800.00	
BGF RETAIL CO LTD	193	185,400.000	35,782,200.00	
E-MART INC	516	98,100.000	50,619,600.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	261	309,000.000	80,649,000.00	
KT&G CORP	3,614	86,000.000	310,804,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	694	140,600.000	97,576,400.00	
AMOREPACIFIC CORP	808	120,600.000	97,444,800.00	
LG H&H	279	609,000.000	169,911,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	3,100	69,500.000	215,450,000.00	
HLB INC	3,856	34,100.000	131,489,600.00	
SD BIOSENSOR INC	604	20,400.000	12,321,600.00	
CELLTRION INC	3,326	165,400.000	550,120,400.00	
CELLTRION PHARM INC	364	83,900.000	30,539,600.00	
HANMI PHARM CO LTD	174	306,500.000	53,331,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	579	786,000.000	455,094,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	1,033	69,700.000	72,000,100.00	

SK BIOSCIENCE CO LTD	550	71,200.000	39,160,000.00		
YUHAN CORP	1,951	56,500.000	110,231,500.00		
HANA FINANCIAL GROUP	9,633	42,100.000	405,549,300.00		
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	7,263	10,170.000	73,864,710.00		
KAKAOBANK CORP	4,453	22,400.000	99,747,200.00		
KB FINANCIAL GROUP INC	12,259	49,750.000	609,885,250.00		
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	14,451	35,650.000	515,178,150.00		
WOORI FINANCIAL GROUP INC	18,331	11,920.000	218,505,520.00		
KAKAOPAY CORP	839	53,600.000	44,970,400.00		
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	1,369	55,800.000	76,390,200.00		
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	3,087	45,600.000	140,767,200.00		
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	8,457	6,830.000	57,761,310.00		
NH INVESTMENT & SECURITIES C	5,391	9,190.000	49,543,290.00		
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	2,379	34,250.000	81,480,750.00		
DB INSURANCE CO LTD	1,283	85,400.000	109,568,200.00		
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	1,033	230,500.000	238,106,500.00		
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	2,525	65,700.000	165,892,500.00		
SAMSUNG SDS CO LTD	1,205	118,300.000	142,551,500.00		
L&F CO LTD	705	271,500.000	191,407,500.00		
LG DISPLAY CO LTD	7,290	16,200.000	118,098,000.00		
LG INNOTEK CO LTD	495	257,500.000	127,462,500.00		
LOTTE ENERGY MATERIALS CORP	643	61,500.000	39,544,500.00		
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1,649	139,700.000	230,365,300.00		
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	150,942	63,600.000	9,599,911,200.00		
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	25,970	53,700.000	1,394,589,000.00		
SAMSUNG SDI CO LTD	1,736	706,000.000	1,225,616,000.00		
SK HYNIX INC	17,232	85,500.000	1,473,336,000.00		
SK SQUARE CO LTD	2,713	39,550.000	107,299,150.00		
LG UPLUS CORP	6,942	11,070.000	76,847,940.00		
KOREA ELECTRIC POWER CORP	7,737	18,560.000	143,598,720.00		
CHEIL WORLDWIDE INC	2,411	18,870.000	45,495,570.00		
HYBE CO LTD	587	260,500.000	152,913,500.00		
KAKAO CORP	9,838	56,000.000	550,928,000.00		
KAKAO GAMES CORP	1,454	39,500.000	57,433,000.00		
KRAFTON INC	874	191,500.000	167,371,000.00		
NAVER CORP	4,142	186,100.000	770,826,200.00		
NCSOFT CORP	485	356,000.000	172,660,000.00		
NETMARBLE CORP	678	64,500.000	43,731,000.00		
PEARL ABYSS CORP	1,209	42,700.000	51,624,300.00		
韓国・ウォン小計	498,583		32,398,006,800.00 (3,239,800,680)		
マレーシ	DIALOG GROUP BHD	135,200	2.300	310,960.00	
ア・リン	PETRONAS DAGANGAN BHD	7,300	22.140	161,622.00	
ギット	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	82,000	7.200	590,400.00	

	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	110,600	5.060	559,636.00	
	GAMUDA BHD	57,800	4.150	239,870.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	20,400	4.830	98,532.00	
	SIME DARBY BERHAD	93,800	2.160	202,608.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	14,700	7.140	104,958.00	
	MISC BHD	42,800	7.330	313,724.00	
	GENTING BHD	60,200	4.710	283,542.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	73,100	2.680	195,908.00	
	MR DIY GROUP M BHD	63,450	1.590	100,885.50	
	IOI CORP BHD	70,600	3.870	273,222.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	13,900	21.880	304,132.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	2,300	136.500	313,950.00	
	PPB GROUP BERHAD	20,240	16.600	335,984.00	
	QL RESOURCES BHD	29,250	5.750	168,187.50	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	59,300	4.480	265,664.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	63,300	5.760	364,608.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	97,900	1.000	97,900.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	68,900	3.640	250,796.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	226,900	5.160	1,170,804.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	22,700	20.280	460,356.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	5,700	18.200	103,740.00	
	MALAYAN BANKING BHD	157,300	8.650	1,360,645.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	468,400	3.930	1,840,812.00	
	RHB BANK BHD	48,000	5.520	264,960.00	
	INARI AMERTRON BHD	92,100	2.300	211,830.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	89,500	3.010	269,395.00	
	CELCOMDIGI BHD	86,400	4.410	381,024.00	
	MAXIS BHD	85,300	4.350	371,055.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	34,000	4.940	167,960.00	
	PETRONAS GAS BHD	21,600	16.980	366,768.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	84,900	8.930	758,157.00	
	マレーシア・リンギット小計	2,609,840		13,264,595.00 (397,521,342)	
南アフリ カ・ランド	EXXARO RESOURCES LTD	7,716	192.130	1,482,475.08	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	3,545	224.720	796,632.40	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	1,562	1,071.990	1,674,448.38	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	13,209	491.870	6,497,110.83	
	GOLD FIELDS LTD	29,268	283.580	8,299,819.44	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	18,015	83.500	1,504,252.50	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	26,912	174.620	4,699,373.44	
	KUMBA IRON ORE LTD	1,588	437.950	695,464.60	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	10,197	173.000	1,764,081.00	
	SASOL LTD	18,017	229.100	4,127,694.70	
	SIBANYE STILLWATER LTD	89,325	39.930	3,566,747.25	

	BIDVEST GROUP LTD	9,128	247.910	2,262,922.48	
	MR PRICE GROUP LTD	9,297	149.400	1,388,971.80	
	NASPERS LTD-N SHS	6,874	3,169.860	21,789,617.64	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	52,954	16.950	897,570.30	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	10,629	94.390	1,003,271.31	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	32,847	65.000	2,135,055.00	
	BID CORP LTD	10,585	415.730	4,400,502.05	
	CLICKS GROUP LTD	7,700	268.420	2,066,834.00	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	15,863	222.550	3,530,310.65	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	11,970	182.750	2,187,517.50	
	ABSA GROUP LTD	26,755	174.270	4,662,593.85	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	2,748	1,589.360	4,367,561.28	
	NEDBANK GROUP LTD	14,528	207.950	3,021,097.60	
	STANDARD BANK GROUP LTD	42,370	169.190	7,168,580.30	
	FIRSTRAND LTD	159,330	63.390	10,099,928.70	
	REINET INVESTMENTS SCA	3,824	395.590	1,512,736.16	
	REMGRO LTD	16,702	138.310	2,310,053.62	
	DISCOVERY LTD	15,759	141.060	2,222,964.54	
	OLD MUTUAL LTD	170,915	11.220	1,917,666.30	
	OUTSURANCE GROUP LTD	26,578	34.700	922,256.60	
	SANLAM LTD	56,226	55.070	3,096,365.82	
	MTN GROUP LTD	53,520	127.140	6,804,532.80	
	VODACOM GROUP LTD	21,750	122.890	2,672,857.50	
	MULTICHOICE GROUP LTD	11,752	113.390	1,332,559.28	
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	14,414	105.200	1,516,352.80	
	南アフリカ・ランド小計	1,024,372		130,398,779.50 (951,911,089)	
タイ・バーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	253,400	9.150	2,318,610.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	46,200	156.000	7,207,200.00	
	PTT PCL-NVDR	318,400	31.000	9,870,400.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	33,900	49.000	1,661,100.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	54,400	32.250	1,754,400.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	78,600	41.250	3,242,250.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	41,600	43.250	1,799,200.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	25,700	303.000	7,787,100.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	135,300	72.250	9,775,425.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR	221,600	8.900	1,972,240.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	229,500	7.550	1,732,725.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	184,500	5.300	977,850.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	98,600	30.750	3,031,950.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	50,491	44.000	2,221,604.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	166,900	13.600	2,269,840.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	110,600	21.400	2,366,840.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	42,800	38.250	1,637,100.00	

	CP ALL PCL-NVDR	189,900	63.750	12,106,125.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	5,400	73.500	396,900.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	106,800	20.300	2,168,040.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	38,500	28.500	1,097,250.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	112,400	13.700	1,539,880.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	338,200	29.500	9,976,900.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	18,000	242.000	4,356,000.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	16,500	126.000	2,079,000.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	103,500	18.000	1,863,000.00	
	SCB X PCL-NVDR	23,400	102.000	2,386,800.00	
	JMT NETWORK SERVICES-NVDR	16,600	38.750	643,250.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	27,100	52.250	1,415,975.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	16,200	34.500	558,900.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	28,000	54.250	1,519,000.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	9,850	888.000	8,746,800.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	39,300	208.000	8,174,400.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	40,400	74.000	2,989,600.00	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	155,567	7.700	1,197,865.90	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	20,900	37.500	783,750.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	10,400	156.000	1,622,400.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	57,500	68.750	3,953,125.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	27,400	62.500	1,712,500.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	99,400	50.500	5,019,700.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	37,900	37.750	1,430,725.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	60,800	69.000	4,195,200.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	233,200	9.700	2,262,040.00	
	タイ・パーツ小計	3,925,608		145,820,959.90 (568,701,744)	
ポーランド・ズロチ	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	20,619	62.230	1,283,120.37	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	4,782	116.200	555,668.40	
	LPP SA	35	10,010.000	350,350.00	
	ALLEGRO.EU SA	10,674	32.355	345,357.27	
	PEPCO GROUP NV	5,020	40.300	202,306.00	
	DINO POLSKA SA	1,669	401.200	669,602.80	
	BANK PEKAO SA	5,123	97.700	500,517.10	
	MBANK SA	302	349.400	105,518.80	
	PKO BANK POLSKI SA	29,089	32.110	934,047.79	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	1,143	340.000	388,620.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	20,323	38.310	778,574.13	
	PGE SA	19,508	6.850	133,629.80	
	CD PROJEKT SA	2,415	111.000	268,065.00	
CYFROWY POLSAT SA	5,742	16.690	95,833.98		
	ポーランド・ズロチ小計	126,444		6,611,211.44 (211,210,354)	

ハンガリー・フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	14,232	2,616.000	37,230,912.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	4,586	8,145.000	37,352,970.00	
	OTP BANK PLC	6,609	9,790.000	64,702,110.00	
ハンガリー・フォリント小計		25,427		139,285,992.00 (54,102,160)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	1,833	21.760	39,886.08	
	MYTILINEOS S.A.	3,156	26.940	85,022.64	
	FF GROUP	123	4.800	590.40	
	OPAP SA	6,174	15.290	94,400.46	
	JUMBO SA	3,650	21.360	77,964.00	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	70,399	1.144	80,536.45	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	81,971	1.326	108,693.54	
	NATIONAL BANK OF GREECE	17,320	4.600	79,672.00	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	6,284	13.400	84,205.60	
	PUBLIC POWER CORP	6,630	8.010	53,106.30	
	TERNA ENERGY SA	2,040	20.480	41,779.20	
ユーロ小計		199,580		745,856.67 (109,469,382)	
合計		72,524,983		23,393,522,044 (23,393,522,044)	

(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	27銘柄	2.5%	3.2%
香港・ドル	株式	191銘柄	21.4%	27.3%
台湾・ドル	株式	88銘柄	13.4%	17.1%
エジプト・ポンド	株式	3銘柄	0.1%	0.1%
トルコ・リラ	株式	17銘柄	0.6%	0.7%
メキシコ・ペソ	株式	18銘柄	1.9%	2.5%
フィリピン・ペソ	株式	16銘柄	0.7%	0.8%
チリ・ペソ	株式	12銘柄	0.5%	0.6%
コロンビア・ペソ	株式	3銘柄	0.1%	0.1%
インド・ルピー	株式	114銘柄	12.4%	15.8%
インドネシア・ルピア	株式	21銘柄	1.8%	2.3%
ブラジル・レアル	株式	44銘柄	4.4%	5.6%
チェコ・コルナ	株式	3銘柄	0.2%	0.2%
韓国・ウォン	株式	102銘柄	10.9%	13.8%
マレーシア・リングgit	株式	34銘柄	1.3%	1.7%
南アフリカ・ランド	株式	36銘柄	3.2%	4.1%
タイ・バーツ	株式	43銘柄	1.9%	2.4%
ポーランド・ズロチ	株式	14銘柄	0.7%	0.9%
ハンガリー・フォリント	株式	3銘柄	0.2%	0.2%
ユーロ	株式	11銘柄	0.4%	0.5%

(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	1,811,400.00	73,071,876.00		
		オフショア・人民元小計	1,811,400.00	73,071,876.00 (1,407,985,442)		
投資信託受益証券合計				1,407,985,442 (1,407,985,442)		
投資証券	アメリカ・ドル	ISHARES MSCI KUWAIT ETF	57,574.00	1,885,203.05		
		ISHARES MSCI QATAR ETF	105,715.00	1,879,612.70		
		ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	211,519.00	8,585,556.21		
		ISHARES MSCI UAE ETF	187,537.00	2,803,678.15		
	アメリカ・ドル小計		562,345.00	15,154,050.11 (2,027,611,906)		
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB-CPO	478,300.00	5,026,933.00		
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	16,575.00	2,523,875.25		
		FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	62,500.00	10,751,875.00		
		GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	74,700.00	1,274,382.00		
		TRUST FIBRA UNO	99,100.00	2,436,869.00		
	メキシコ・ペソ小計		731,175.00	22,013,934.25 (163,151,871)		
	ブラジル・レアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	37,200.00	844,440.00		
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	10,500.00	278,880.00		
		ENERGISA SA-UNITS	4,800.00	199,824.00		
		KLABIN SA - UNIT	23,300.00	427,322.00		
	ブラジル・レアル小計		75,800.00	1,750,466.00 (46,331,159)		
	南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	95,658.00	1,176,593.40		
	南アフリカ・ランド小計		95,658.00	1,176,593.40 (8,589,132)		
	投資証券合計				2,245,684,067 (2,245,684,067)	
	合計				3,653,669,509 (3,653,669,509)	

(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	-	6.8%	55.5%
メキシコ・ペソ	投資証券	5銘柄	-	0.5%	4.5%
ブラジル・レアル	投資証券	4銘柄	-	0.2%	1.3%
オフショア・人民元	投資信託受益証券	1銘柄	4.7%	-	38.5%
南アフリカ・ランド	投資証券	1銘柄	-	0.0%	0.2%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

日本国債ダイナミック・アロケーション・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2022年4月26日現在)	(2023年4月26日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	30,319,099	63,655,599
コール・ローン	1,529,273,235	2,855,964,411
国債証券	7,696,183,620	4,830,406,571
未収利息	5,550,727	5,364,846
前払費用	2,318,062	2,804,946
流動資産合計	9,263,644,743	7,758,196,373
資産合計	9,263,644,743	7,758,196,373
負債の部		
流動負債		
未払金	164,704,500	236,745,000
未払解約金	1,000,000	-
その他未払費用	3,304	6,430
流動負債合計	165,707,804	236,751,430
負債合計	165,707,804	236,751,430
純資産の部		
元本等		
元本	7,859,603,975	6,583,754,367
剰余金		
剰余金又は欠損金()	1,238,332,964	937,690,576
元本等合計	9,097,936,939	7,521,444,943
純資産合計	9,097,936,939	7,521,444,943
負債純資産合計	9,263,644,743	7,758,196,373

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年4月27日 至 2023年4月26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>
--	---

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項 目	（2022年4月26日現在）	（2023年4月26日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	7,859,603,975口	6,583,754,367口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1576円 （1万口当たりの純資産額11,576円）	1口当たり純資産額 1.1424円 （1万口当たりの純資産額11,424円）

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項 目	自 2022年4月27日 至 2023年4月26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券</p> <p>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券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>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>
--------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年4月26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。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2022年4月27日 至 2023年4月26日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2022年4月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	9,636,327,340円
同期中における追加設定元本額	2,107,061,428円
同期中における一部解約元本額	3,883,784,793円
2022年4月26日現在の元本の内訳	
イオン・バランス戦略ファンド	1,191,202,555円
S M A M・年金日本国債ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家 限定>	6,668,401,420円
合 計	7,859,603,975円

(2023年4月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	7,859,603,975円
同期中における追加設定元本額	332,657,815円
同期中における一部解約元本額	1,608,507,423円
2023年4月26日現在の元本の内訳	
イオン・バランス戦略ファンド	740,997,629円
S M A M・年金日本国債ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家 限定>	5,842,756,738円
合 計	6,583,754,367円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位 : 円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	5 4 0 年国債	18,100,000	21,048,671	
	6 4 0 年国債	50,000,000	57,197,000	
	1 0 4 0 年国債	70,000,000	61,389,300	
	1 3 4 0 年国債	20,000,000	14,982,800	
	1 4 4 0 年国債	50,000,000	39,997,000	
	1 5 4 0 年国債	30,000,000	26,315,100	
	3 6 0 1 0 年国債	450,000,000	443,965,500	
	3 6 1 1 0 年国債	170,000,000	167,331,000	
	3 6 2 1 0 年国債	50,000,000	49,096,000	

363	10年国債	170,000,000	166,566,000	
370	10年国債	150,000,000	150,639,000	
34	30年国債	5,000,000	5,978,800	
46	30年国債	50,000,000	53,481,500	
48	30年国債	50,000,000	52,413,000	
52	30年国債	120,000,000	103,330,800	
57	30年国債	30,000,000	27,327,300	
58	30年国債	100,000,000	90,852,000	
60	30年国債	60,000,000	55,470,000	
62	30年国債	90,000,000	74,746,800	
64	30年国債	10,000,000	8,010,600	
66	30年国債	30,000,000	23,858,400	
67	30年国債	10,000,000	8,376,800	
70	30年国債	100,000,000	85,613,000	
74	30年国債	10,000,000	9,234,000	
75	30年国債	20,000,000	19,894,800	
76	30年国債	100,000,000	101,910,000	
78	30年国債	100,000,000	101,824,000	
142	20年国債	200,000,000	225,594,000	
143	20年国債	400,000,000	443,788,000	
146	20年国債	200,000,000	224,168,000	
149	20年国債	90,000,000	99,084,600	
151	20年国債	200,000,000	213,414,000	
155	20年国債	260,000,000	270,160,800	
157	20年国債	170,000,000	159,094,500	
161	20年国債	90,000,000	87,991,200	
163	20年国債	70,000,000	68,074,300	
167	20年国債	100,000,000	94,577,000	
168	20年国債	10,000,000	9,278,800	
170	20年国債	50,000,000	45,292,000	
171	20年国債	70,000,000	63,186,200	
172	20年国債	80,000,000	73,167,200	
173	20年国債	60,000,000	54,649,800	
175	20年国債	170,000,000	156,542,800	
180	20年国債	240,000,000	230,174,400	
181	20年国債	10,000,000	9,745,300	
182	20年国債	80,000,000	80,579,200	
183	20年国債	190,000,000	200,995,300	
	国債証券 小計		4,830,406,571	
	合計		4,830,406,571	

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。

【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8期中間計算期間(2023年4月27日から2023年10月26日まで)の中間財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人により中間監査を受けております。

【イオン・バランス戦略ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第7期 (2023年 4月26日現在)	第8期中間計算期間 (2023年10月26日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	3,302,157	6,065,552
金銭信託	1,039,513	729,232
コール・ローン	46,638,683	42,171,306
投資証券	174,635,654	114,884,130
親投資信託受益証券	2,659,817,137	2,794,225,094
未収入金	-	7,000,000
流動資産合計	2,885,433,144	2,965,075,314
資産合計	2,885,433,144	2,965,075,314
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,647,431	12,441,346
未払受託者報酬	459,260	486,720
未払委託者報酬	13,013,847	13,791,533
その他未払費用	91,883	97,370
流動負債合計	15,212,421	26,816,969
負債合計	15,212,421	26,816,969
純資産の部		
元本等		
元本	3,162,075,005	3,313,130,724
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	291,854,282	374,872,379
(分配準備積立金)	79,242,530	74,336,251
元本等合計	2,870,220,723	2,938,258,345
純資産合計	2,870,220,723	2,938,258,345
負債純資産合計	2,885,433,144	2,965,075,314

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第7期中間計算期間 自 2022年 4月27日 至 2022年10月26日	第8期中間計算期間 自 2023年 4月27日 至 2023年10月26日
営業収益		
受取配当金	-	2,320,295
受取利息	1,771	36,747
有価証券売買等損益	162,245,501	72,169,825
為替差損益	201,774	14,543,536
営業収益合計	162,041,956	55,269,247
営業費用		
支払利息	7,128	13,420
受託者報酬	459,504	486,720
委託者報酬	13,020,635	13,791,533
その他費用	103,129	121,606
営業費用合計	13,590,396	14,413,279
営業利益又は営業損失 ()	175,632,352	69,682,526
経常利益又は経常損失 ()	175,632,352	69,682,526
中間純利益又は中間純損失 ()	175,632,352	69,682,526
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 ()	3,228,171	1,491,013
期首剰余金又は期首欠損金 ()	68,103,192	291,854,282
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,263,343	18,913,279
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,263,343	18,913,279
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	13,950,746	30,757,837
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	13,950,746	30,757,837
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金 ()	251,194,776	374,872,379

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第8期中間計算期間 自 2023年4月27日 至 2023年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第7期 (2023年4月26日現在)	第8期中間計算期間 (2023年10月26日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	3,162,075,005口	3,313,130,724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 291,854,282円	元本の欠損 374,872,379円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9077円 (1万口当たりの純資産額9,077円)	1口当たり純資産額 0.8869円 (1万口当たりの純資産額8,869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8期中間計算期間 (2023年10月26日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(投資証券、親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
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7期 (2023年4月26日現在)	第8期中間計算期間 (2023年10月26日現在)
期首元本額	2,834,720,287円	3,162,075,005円
期中追加設定元本額	558,208,711円	357,232,468円
期中一部解約元本額	230,853,993円	206,176,749円

(参考)

イオン・バランス戦略ファンドは、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド」、「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」、「エマージング株式インデックス・マザーファンド」および「日本国債ダイナミック・アロケーション・マザーファンド」受益証券を投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

(1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2023年4月26日現在)	(2023年10月26日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	77,873,996	43,200,231
コール・ローン	3,493,885,269	2,498,258,910
株式	228,784,745,920	260,581,395,680
派生商品評価勘定	123,674,400	71,700
未収入金	2,162,700	-
未収配当金	2,721,055,618	2,534,008,510
前払金	-	167,420,000
差入委託証拠金	252,720,000	207,900,000

流動資産合計	235,456,117,903	266,032,255,031
資産合計	235,456,117,903	266,032,255,031
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	237,290,200
前受金	183,867,000	-
未払解約金	184,681,894	10,467,636
その他未払費用	7,279	6,461
流動負債合計	368,556,173	247,764,297
負債合計	368,556,173	247,764,297
純資産の部		
元本等		
元本	66,762,415,456	67,916,997,662
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	168,325,146,274	197,867,493,072
元本等合計	235,087,561,730	265,784,490,734
純資産合計	235,087,561,730	265,784,490,734
負債純資産合計	235,456,117,903	266,032,255,031

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2023年4月27日 至 2023年10月26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	(2023年4月26日現在)	(2023年10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	66,762,415,456口	67,916,997,662口

2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3,5213円 (1万口当たりの純資産額35,213円)	1口当たり純資産額 3,9134円 (1万口当たりの純資産額39,134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10月26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)

(2023年4月26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	6,130,485,600	-	6,254,160,000	123,674,400
	小計	6,130,485,600	-	6,254,160,000	123,674,400
合計		6,130,485,600	-	6,254,160,000	123,674,400

(2023年10月26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 0512月	5,462,443,500	-	5,225,225,000	237,218,500
	小計	5,462,443,500	-	5,225,225,000	237,218,500
合計		5,462,443,500	-	5,225,225,000	237,218,500

(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)

(2023年4月26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	63,261,805,196円
同期中における追加設定元本額	11,313,741,080円
同期中における一部解約元本額	7,813,130,820円
2023年4月26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	9,541,646,378円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	1,053,129,139円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,638,337,817円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,648,450,453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)	147,886,289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)	4,103,425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)	17,551,503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)	60,632,108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)	161,751,822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)	149,466,737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)	270,019,283円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,277,876,561円
三井住友・DCつみたてN I S A・日本株インデックスファンド	23,755,768,792円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	224,604,200円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	287,321,128円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	179,357,049円
イオン・バランス戦略ファンド	48,802,794円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	46,993,691円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	204,665,988円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	195,201,725円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	723,192,816円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	403,895,409円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	462,418,802円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	54,207,734円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	916,545,618円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	42,196,966円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	229,099,641円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	220,770,026円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	5,914,751円
日興F W S・日本株インデックス	1,553,047,725円
三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド	33,767,021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DS・DCターゲットイヤーファンド2040	52,024円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	62,482円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	74,595円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	74,595円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	36,977円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	53,380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)	64,358円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	74,521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)	84,740円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,330,712,282円
バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉	12,042,513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〉	65,084,989円
SMAM・バランスファンドVA25〈適格機関投資家専用〉	1,258,805,092円
SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉	1,360,835,172円
SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉	5,212,512,213円
SMAM・バランスファンドVL30〈適格機関投資家限定〉	35,485,948円
SMAM・バランスファンドVL50〈適格機関投資家限定〉	128,454,719円
SMAM・バランスファンドVA75〈適格機関投資家専用〉	625,303,090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〉	42,743,164円
SMAM・インデックス・バランスVA25〈適格機関投資家専用〉	227,367,598円
SMAM・インデックス・バランスVA50〈適格機関投資家専用〉	724,446,785円
SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉	505,587,630円
SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉	1,512,636,473円
SMAM・バランスVA株40T〈適格機関投資家限定〉	352,709円
SMAM・グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉	33,786,896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〉	88,502,143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〉	47,497,470円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2〈適格機関投資家専用〉	35,298,082円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2〈適格機関投資家専用〉	7,431,986円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2〈適格機関投資家専用〉	38,379,381円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2〈適格機関投資家専用〉	486,166,361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)	158,733,909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〉	179,946,203円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA〈適格機関投資家限定〉	78,463,864円
SMAM・世界バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	76,811,589円
SMAM・世界バランスファンドVA2〈適格機関投資家限定〉	38,854,455円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド〈適格機関投資家限定〉	51,538,394円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04〈適格機関投資家限定〉	37,247,656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〉	48,176,456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〉	442,012,325円
SMDAM・日米3資産バランスオープン〈適格機関投資家限定〉	17,181,246円
合計	66,762,415,456円

(2023年10月26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	66,762,415,456円
同期中における追加設定元本額	6,264,961,438円
同期中における一部解約元本額	5,110,379,232円

2023年10月26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	9,666,013,340円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	997,874,888円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	4,490,373,045円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	3,648,556,330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）	137,422,193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）	3,547,260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）	15,678,498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）	54,424,008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）	156,034,664円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）	145,244,054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）	268,045,364円
国内株式指数ファンド（T O P I X ）	1,445,382,499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	25,853,649,035円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	214,908,297円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	268,228,648円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	160,911,196円
イオン・バランス戦略ファンド	88,640,642円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	49,532,606円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	210,360,587円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	196,875,508円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	770,933,149円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	444,918,982円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	514,480,525円
三井住友・DCつみたてN I S A ・世界分散ファンド	54,727,579円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	1,125,823,355円
三井住友DS・年金バランス30（債券重点型）	39,885,415円
三井住友DS・年金バランス50（標準型）	234,946,785円
三井住友DS・年金バランス70（株式重点型）	240,167,448円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	5,742,005円
日興F W S ・日本株インデックス	1,777,300,259円
三井住友DS・T O P I X インデックス・ファンド	61,431,478円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	446,829円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	323,902円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	158,002円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	88,234円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	89,365円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）	420,971円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）	6,900,861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）	30,204,271円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）	14,455,610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)	6,321,567円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,428,614,722円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	8,641,322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>	50,064,321円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	1,004,786,924円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	1,180,654,038円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	4,552,064,730円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	29,416,152円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	112,870,377円
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	593,576,413円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型 <適格機関投資家限定>	35,782,862円
SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	195,641,630円
SMAM・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>	648,284,955円
SMAM・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>	417,050,458円
SMAM・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>	1,289,551,079円
SMAM・バランスVA株40T <適格機関投資家限定>	314,855円
SMAM・グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	27,021,199円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	30,809,683円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用>	26,636,479円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用>	14,740,890円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用>	70,523,025円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用>	177,257,789円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2 <適格機関投資家専用>	37,992,956円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2 <適格機関投資家専用>	33,340,590円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2 <適格機関投資家専用>	6,832,341円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2 <適格機関投資家専用>	31,790,234円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2 <適格機関投資家専用>	419,590,878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)	150,606,783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>	159,779,160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>	65,272,266円
SMAM・世界バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	52,101,715円
SMAM・世界バランスファンドVA2 <適格機関投資家限定>	31,518,773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>	52,669,232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>	31,177,254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>	49,877,598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>	444,960,882円
SMDAM・日米3資産バランスオープン <適格機関投資家限定>	17,621,175円
SMDAM・年金Wリスクコントロールファンド(リスク3%) <適格機関投資家限定>	36,092,668円
合計	67,916,997,662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)

(2023年4月26日現在)

(2023年10月26日現在)

資産の部

流動資産		
預金	6,702,892,516	5,819,635,845
金銭信託	9,800,314	7,023,225
コール・ローン	439,699,703	406,151,409
株式	452,176,827,385	546,799,353,141
投資証券	10,366,469,694	11,003,759,429
派生商品評価勘定	242,734,524	498,345
未収入金	218,330,537	-
未収配当金	659,494,557	445,628,124
差入委託証拠金	2,627,423,933	2,332,742,254
流動資産合計	473,443,673,163	566,814,791,772
資産合計	473,443,673,163	566,814,791,772
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	23,659,454	338,894,711
未払金	212,695,934	-
未払解約金	594,926,603	121,650,101
その他未払費用	1,889	3,096
流動負債合計	831,283,880	460,547,908
負債合計	831,283,880	460,547,908
純資産の部		
元本等		
元本	75,868,330,761	80,735,892,707
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	396,744,058,522	485,618,351,157
元本等合計	472,612,389,283	566,354,243,864
純資産合計	472,612,389,283	566,354,243,864
負債純資産合計	473,443,673,163	566,814,791,772

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年4月27日 至 2023年10月26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	(2023年4月26日現在)	(2023年10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	75,868,330,761口	80,735,892,707口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 6.2294円 (1万口当たりの純資産額62,294円)	1口当たり純資産額 7.0149円 (1万口当たりの純資産額70,149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10月26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)

(2023年4月26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 JUN23	7,212,730,844	-	7,338,869,790	126,138,946

市場取引	SPI 200 FUTURES JUN23	364,385,196	-	375,114,671	10,729,475
	FTSE 100 IDX FUT JUN23	441,521,738	-	458,324,724	16,802,986
	EURO STOXX 50 JUN23	1,514,005,935	-	1,578,258,906	64,252,971
	小計	9,532,643,713	-	9,750,568,091	217,924,378
	合 計	9,532,643,713	-	9,750,568,091	217,924,378

(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	273,095,473	-	272,826,452	269,021
	カナダ・ドル	29,195,825	-	28,962,303	233,522
	イギリス・ポンド	107,876,898	-	107,375,278	501,620
	ユーロ	59,424,831	-	59,278,301	146,530
	小計	469,593,027	-	468,442,334	1,150,693
合 計		469,593,027	-	468,442,334	1,150,693

(2023年10月26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 DEC23	7,083,197,584	-	6,800,893,223	282,304,361
	SPI 200 FUTURES DEC23	284,571,692	-	275,194,045	9,377,647
	FTSE 100 IDX FUT DEC23	403,506,534	-	392,026,373	11,480,161
	EURO STOXX 50 DEC23	1,307,259,510	-	1,271,580,576	35,678,934
	小計	9,078,535,320	-	8,739,694,217	338,841,103
	合 計	9,078,535,320	-	8,739,694,217	338,841,103

(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	335,992,917	-	336,433,796	440,879
	ユーロ	41,074,343	-	41,078,202	3,859
	小計	377,067,260	-	377,511,998	444,738
合 計		377,067,260	-	377,511,998	444,738

(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)

(2023年4月26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	63,556,720,108円
同期中における追加設定元本額	22,882,025,465円
同期中における一部解約元本額	10,570,414,812円
2023年4月26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	38,000,129,125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)	831,380,132円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	34,107,550円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	984,101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)	5,026,458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)	15,450,395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)	44,487,949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)	53,550,838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)	110,637,272円
外国株式指数ファンド	981,891,869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	19,613,006,783円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	98,647,755円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	137,664,681円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	85,754,219円
イオン・バランス戦略ファンド	27,693,062円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	24,013,179円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	143,451,431円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	129,678,228円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	476,953,561円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	260,048,259円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	301,879,419円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	60,337,638円
三井住友D S・外国株式インデックス年金ファンド	1,968,168,326円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	11,779,774円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	53,826,792円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	49,329,167円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	3,035,727円
S M B C・DCインデックスファンド(M S C Iコクサイ)	634,513,472円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	319,915,262円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	1,813,910,204円
三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド	72,066,098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)	410,594,212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>	3,298,003円
S M A M・バランスファンドV A安定成長型 <適格機関投資家限定>	18,661,339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>	465,973,019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>	665,541,241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>	2,896,070,331円
S M A M・バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	9,822,476円
S M A M・バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定>	47,808,223円
S M A M・バランスファンドV A 7 5 <適格機関投資家専用>	397,658,711円
S M A M・バランスファンドV L 国際分散型 <適格機関投資家限定>	35,766,460円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5 <適格機関投資家専用>	84,832,561円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0 <適格機関投資家専用>	411,687,872円
S M A M・バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用>	279,773,836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>	633,254,726円

SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	195,290円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	184,292,025円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	56,631,240円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	7,051,860円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	6,575,296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>	100,881,036円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	44,957,268円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	229,339,986円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	68,183,758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>	678,535,453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>	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>	14,979,993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>	19,482,776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>	208,960,218円
合計	75,868,330,761円

(2023年10月26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	75,868,330,761円
同期中における追加設定元本額	8,849,425,030円
同期中における一部解約元本額	3,981,863,084円
2023年10月26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	40,447,743,547円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	284,224,466円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,109,881,721円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	827,641,133円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	31,904,639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)	864,168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)	4,354,421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)	13,925,642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)	44,149,077円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	52,838,474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)	110,923,162円
外国株式指数ファンド	1,024,575,237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	21,524,658,850円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	76,940,755円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	112,290,591円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	69,085,473円
イオン・バランス戦略ファンド	33,199,045円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	25,313,434円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	147,222,164円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	131,925,460円

三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	510,948,267円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	304,197,281円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	409,320,954円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	62,331,528円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	2,280,435,432円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	11,239,695円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	56,740,693円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	53,290,996円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,970,436円
SMBC・DCインデックスファンド(MSCIコクサイ)	986,328,093円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	231,040,571円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	2,223,536,494円
三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド	107,911,404円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	201,167円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	153,880円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	77,188円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	45,172円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	47,405円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	107,460円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	1,845,751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)	8,149,436円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	3,906,379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)	1,725,841円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	343,489,471円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	2,342,779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>	13,946,237円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	371,067,462円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	588,323,269円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	2,569,581,658円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	8,325,935円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	41,243,434円
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	380,332,088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>	29,673,252円
SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	72,529,431円
SMAM・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>	370,804,055円
SMAM・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>	235,962,328円
SMAM・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>	545,020,925円
SMAM・バランスVA株40T <適格機関投資家限定>	179,149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)	173,021,260円
SMAM・グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	46,578,616円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	5,706,690円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用>	5,839,402円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用>	3,468,121円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用>	13,000,940円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用>	42,051,555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>	88,244,496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>	38,344,500円
SMAM・世界バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	159,921,068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 >	55,985,552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 >	1,049,126,516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 >	26,347,184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 >	15,789,389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 >	25,485,675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 >	74,191,873円
S M D A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド（リスク3%）< 適格機関投資家限定 >	9,755,415円
合 計	80,735,892,707円

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2023年4月26日現在)	(2023年10月26日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	31,588,157	28,593,321
金銭信託	3,681,111	3,370,779
コール・ローン	165,156,296	194,931,318
国債証券	25,666,463,041	20,806,414,897
派生商品評価勘定	8,236,642	26,338,726
未収利息	158,452,611	140,881,169
前払費用	38,682,573	35,802,920
流動資産合計	26,072,260,431	21,236,333,130
資産合計	26,072,260,431	21,236,333,130
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	279,487,082	172,282,823
未払解約金	10,000,000	2,000,000
その他未払費用	362	350
流動負債合計	289,487,444	174,283,173
負債合計	289,487,444	174,283,173
純資産の部		
元本等		
元本	20,379,424,891	17,866,906,470
剰余金		
剰余金又は欠損金 ()	5,403,348,096	3,195,143,487
元本等合計	25,782,772,987	21,062,049,957
純資産合計	25,782,772,987	21,062,049,957
負債純資産合計	26,072,260,431	21,236,333,130

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2023年4月27日 至 2023年10月26日
-----	-------------------------------

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<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	（2023年4月26日現在）	（2023年10月26日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	20,379,424,891口	17,866,906,470口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2651円 （1万口当たりの純資産額12,651円）	1口当たり純資産額 1.1788円 （1万口当たりの純資産額11,788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10月26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>
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)

(2023年4月26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	12,625,754,514	-	12,734,784,448	109,029,934
	カナダ・ドル	526,969,746	-	527,376,114	406,368
	オーストラリア・ド ル	407,499,587	-	406,622,133	877,454
	シンガポール・ドル	251,133,939	-	251,642,916	508,977
	ニュージーランド・ ドル	61,330,925	-	60,695,540	635,385
	イギリス・ポンド	1,253,938,634	-	1,267,625,655	13,687,021
	イスラエル・シケ ル	83,869,197	-	83,508,192	361,005
	デンマーク・クロー ネ	80,788,138	-	82,213,494	1,425,356
	ノルウェー・クロー ネ	42,291,540	-	41,759,018	532,522
	スウェーデン・ク ローナ	52,169,348	-	52,887,816	718,468
	メキシコ・ペソ	227,639,418	-	230,295,032	2,655,614
	オフショア・人民元	1,287,571,114	-	1,281,910,140	5,660,974
	ポーランド・ズロチ	118,943,534	-	123,575,672	4,632,138
	ユーロ	8,533,736,703	-	8,679,990,607	146,253,904
	小計	25,553,636,337	-	25,824,886,777	271,250,440
	合 計	25,553,636,337	-	25,824,886,777	271,250,440

(2023年10月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	156,526,797	-	157,494,750	967,953
	カナダ・ドル	5,444,931	-	5,431,940	12,991
	オーストラリア・ド ル	5,681,566	-	5,654,850	26,716
	シンガポール・ドル	2,172,654	-	2,186,900	14,246
	イギリス・ポンド	16,208,433	-	16,324,425	115,992

市場取引以 外の取引	デンマーク・クロー ネ	838,600	-	849,352	10,752
	メキシコ・ペソ	2,678,528	-	2,608,960	69,568
	オフショア・人民元	24,629,312	-	24,757,568	128,256
	ユーロ	101,588,344	-	103,003,875	1,415,531
	小計	315,769,165	-	318,312,620	2,543,455
	売建				
	アメリカ・ドル	10,329,723,666	-	10,441,151,950	111,428,284
	カナダ・ドル	429,062,533	-	424,777,708	4,284,825
	オーストラリア・ド ル	317,093,794	-	311,959,225	5,134,569
	シンガポール・ドル	207,971,257	-	208,848,950	877,693
	ニュージーランド・ ドル	49,051,039	-	47,698,750	1,352,289
	イギリス・ポンド	1,047,966,311	-	1,048,390,850	424,539
	イスラエル・シュケ ル	63,826,260	-	60,507,964	3,318,296
	デンマーク・クロー ネ	67,539,049	-	67,948,160	409,111
	ノルウェー・クロー ネ	34,295,220	-	32,884,050	1,411,170
スウェーデン・ク ローナ	41,843,566	-	41,130,378	713,188	
メキシコ・ペソ	197,266,579	-	190,372,550	6,894,029	
オフショア・人民元	1,503,381,693	-	1,508,370,176	4,988,483	
ポーランド・ズロチ	104,106,433	-	108,306,864	4,200,431	
ユーロ	6,942,318,723	-	6,991,586,100	49,267,377	
小計	21,335,446,123	-	21,483,933,675	148,487,552	
合 計	21,651,215,288	-	21,802,246,295	145,944,097	

(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)

(2023年4月26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	18,855,361,405円
同期中における追加設定元本額	10,023,809,737円
同期中における一部解約元本額	8,499,746,251円
2023年4月26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)	2,567,649,301円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,343,499,078円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	392,892,525円
イオン・バランス戦略ファンド	668,406,963円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	2,929,661,404円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,120,683,571円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	2,115,322,668円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	522,714,645円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	173,824,287円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	73,256,743円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)	569,188,851円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	259,539円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	174,238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)	117,354円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	66,146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)	15,745円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,112,417,357円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	885,316円
SMAM・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	5,389,448,436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>	433,278,912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>	423,711,441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>	541,950,371円
合計	20,379,424,891円

(2023年10月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	20,379,424,891円
同期中における追加設定元本額	6,395,177,131円
同期中における一部解約元本額	8,907,695,552円
2023年10月26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)	2,641,091,516円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,452,019,769円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	429,266,782円
イオン・バランス戦略ファンド	740,233,481円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,408,949,948円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	619,399,538円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	1,241,936,846円

三井住友・資産最適化ファンド(4 やや成長型)	344,668,268円
三井住友・資産最適化ファンド(5 成長重視型)	56,782,365円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	91,665,884円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)	427,756,199円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	4,476,218円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	31,114,805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)	74,559,314円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	17,657,247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)	1,877,540円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,087,053,848円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,006,607円
SMAM・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	5,511,814,995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>	617,385,792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>	387,932,299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>	619,816,861円
SMDAM・年金Wリスクコントロールファンド(リスク3%)<適格機関投資家限定>	58,440,348円
合計	17,866,906,470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)

	(2023年4月26日現在)	(2023年10月26日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,272,611	1,063,859
コール・ローン	57,096,830	61,522,707
投資証券	11,894,179,800	13,036,619,700
派生商品評価勘定	567,600	-
未収入金	361,845	-
未収配当金	100,155,423	111,090,796
前払金	-	1,354,000
差入委託証拠金	2,200,000	2,190,000
流動資産合計	12,055,834,109	13,213,841,062
資産合計	12,055,834,109	13,213,841,062
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	1,608,400
前受金	502,000	-
未払解約金	9,141,726	948,809
その他未払費用	175	318
流動負債合計	9,643,901	2,557,527
負債合計	9,643,901	2,557,527
純資産の部		
元本等		
元本	4,656,679,582	5,105,915,338

剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	7,389,510,626	8,105,368,197
元本等合計	12,046,190,208	13,211,283,535
純資産合計	12,046,190,208	13,211,283,535
負債純資産合計	12,055,834,109	13,213,841,062

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年4月27日 至 2023年10月26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	(2023年4月26日現在)	(2023年10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	4,656,679,582口	5,105,915,338口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.5869円 (1万口当たりの純資産額25,869円)	1口当たり純資産額 2.5874円 (1万口当たりの純資産額25,874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10月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>

	(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)

(2023年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	リート指数先物取引 買建				
	TREIT 先物 0506月	36,382,400	-	36,950,000	567,600
	小計	36,382,400	-	36,950,000	567,600
合計		36,382,400	-	36,950,000	567,600

(2023年10月26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 0512月	37,778,400	-	36,170,000	1,608,400
	小計	37,778,400	-	36,170,000	1,608,400
合計		37,778,400	-	36,170,000	1,608,400

(注) 1. 時価の算定方法

リート指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2) リート指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(2023年4月26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	3,142,280,407円
同期中における追加設定元本額	2,675,443,232円

同期中における一部解約元本額	1,161,044,057円
2023年4月26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)	106,278,351円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	226,277,045円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	145,951,570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	2,414,888,532円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	16,625,490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)	108,066,777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	36,836,717円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,116,803円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	200,922,509円
日興FWS・Jリートインデックス	463,897,650円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	55,408,102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>	65,394,901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>	65,793,891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>	83,971,169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>	215,671,399円
合計	4,656,679,582円

(2023年10月26日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	4,656,679,582円
同期中における追加設定元本額	1,295,365,562円
同期中における一部解約元本額	846,129,806円
2023年10月26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)	171,386,140円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	279,304,729円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	162,892,803円

イオン・バランス戦略ファンド	68,580,710円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	2,576,580,468円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	19,816,199円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	39,830,330円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	39,485,616円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	170,227,180円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	106,104,192円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	78,657,060円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	41,509,997円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,289,606円
三井住友D S・国内リートインデックス年金ファンド	240,328,875円
日興F W S・Jリートインデックス	689,597,385円
三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド	54,487,322円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	106,604円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	88,382円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	53,671円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	34,670円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	36,527円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	175,864円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	5,553,522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)	27,571,277円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	14,392,234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)	6,730,870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>	3,148,468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>	77,215,134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>	46,206,235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>	74,020,041円
S M D A M・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%) <適格機関投資家限定>	109,503,227円
合 計	5,105,915,338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)

	(2023年4月26日現在)	(2023年10月26日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	392,912,925	1,072,922,186
金銭信託	945,305	557,284
コール・ローン	42,411,962	32,227,624
投資証券	25,711,873,581	26,383,930,679
派生商品評価勘定	111,677	45,739
未収入金	1,023,778	-
未収配当金	29,745,104	18,137,648
流動資産合計	26,179,024,332	27,507,821,160
資産合計	26,179,024,332	27,507,821,160

負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	44,342	-
未払解約金	35,803,679	549,889
その他未払費用	147	203
流動負債合計	35,848,168	550,092
負債合計	35,848,168	550,092
純資産の部		
元本等		
元本	9,786,238,628	10,219,201,955
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	16,356,937,536	17,288,069,113
元本等合計	26,143,176,164	27,507,271,068
純資産合計	26,143,176,164	27,507,271,068
負債純資産合計	26,179,024,332	27,507,821,160

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2023年4月27日 至 2023年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 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	(2023年4月26日現在)	(2023年10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	9,786,238,628口	10,219,201,955口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.6714円 (1万口当たりの純資産額26,714円)	1口当たり純資産額 2.6917円 (1万口当たりの純資産額26,917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10月26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）

（2023年4月26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	21,200,000	-	21,155,658	44,342
	小計	21,200,000	-	21,155,658	44,342
	売建				
	アメリカ・ドル	28,800,000	-	28,688,323	111,677
	小計	28,800,000	-	28,688,323	111,677
合計		50,000,000	-	49,843,981	67,335

（2023年10月26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	23,000,000	-	23,045,739	45,739
	小計	23,000,000	-	23,045,739	45,739
合計		23,000,000	-	23,045,739	45,739

(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)

(2023年4月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	7,379,512,147円
同期中における追加設定元本額	3,125,237,771円
同期中における一部解約元本額	718,511,290円
2023年4月26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)	17,744,118円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	22,881,934円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	14,260,020円
イオン・バランス戦略ファンド	106,804,485円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	7,877,234,525円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	7,518,523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)	101,405,598円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	80,533,577円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	105,914,022円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	936,183円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド	366,784,512円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	96,992,357円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	476,889,037円
三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド	45,174,711円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	7,339円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	7,706円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	9,541円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	11,376円

三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	11,376円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	2,761円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	4,369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)	5,602円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	6,885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)	7,844円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	35,722,574円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	41,936,211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>	90,004,296円
合計	9,786,238,628円

(2023年10月26日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	9,786,238,628円
同期中における追加設定元本額	1,252,221,881円
同期中における一部解約元本額	819,258,554円
2023年10月26日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	3,503,368円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	10,939,878円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	9,172,834円
イオン・バランス戦略ファンド	42,288,162円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	8,224,798,864円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	8,679,082円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	37,444,020円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	37,200,443円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	156,354,523円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	97,211,937円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	72,540,879円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	118,137,606円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	984,435円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド	352,565,375円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	83,256,846円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	702,017,875円
三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド	116,983,566円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	78,432円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	50,578円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	25,839円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	15,273円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	15,587円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	30,148円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	398,041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)	2,028,885円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	946,342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)	415,154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>	34,040,769円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	48,136,924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>	58,940,290円
合計	10,219,201,955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)

	(2023年4月26日現在)	(2023年10月26日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	2,185,437,246	1,617,024,128
金銭信託	2,359,458	1,842,985
コール・ローン	105,859,147	106,579,378
株式	23,393,522,044	28,760,088,780
投資信託受益証券	1,407,985,442	1,549,577,950
投資証券	2,245,684,067	2,594,569,811
派生商品評価勘定	7,567,059	46,809
未収入金	112,304	-
未収配当金	26,923,620	38,980,956
差入委託証拠金	500,135,192	831,410,884
流動資産合計	29,875,585,579	35,500,121,681
資産合計	29,875,585,579	35,500,121,681
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	21,435,746	156,421,944
未払解約金	7,697,534	33,588,812
その他未払費用	286	608
流動負債合計	29,133,566	190,011,364
負債合計	29,133,566	190,011,364
純資産の部		
元本等		
元本	18,515,218,766	20,106,845,076
剰余金		
剰余金又は欠損金()	11,331,233,247	15,203,265,241
元本等合計	29,846,452,013	35,310,110,317
純資産合計	29,846,452,013	35,310,110,317
負債純資産合計	29,875,585,579	35,500,121,681

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年4月27日 至 2023年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、投資信託受益証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。

	<p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券</p> <p>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券</p> <p>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 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	(2023年4月26日現在)	(2023年10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	18,515,218,766口	20,106,845,076口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.6120円 (1万口当たりの純資産額16,120円)	1口当たり純資産額 1.7561円 (1万口当たりの純資産額17,561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10月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（株式、投資信託受益証券、投資証券）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
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)

(2023年4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MSCI EMGMKT JUN23	2,813,823,366	-	2,800,166,400	13,656,966
	小計	2,813,823,366	-	2,800,166,400	13,656,966
合 計		2,813,823,366	-	2,800,166,400	13,656,966

（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	54,600,000	-	54,388,279	211,721
	小計	54,600,000	-	54,388,279	211,721
合 計		54,600,000	-	54,388,279	211,721

（2023年10月26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 DEC23	2,554,258,065	-	2,397,836,121	156,421,944
	小計	2,554,258,065	-	2,397,836,121	156,421,944
合 計		2,554,258,065	-	2,397,836,121	156,421,944

（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	22,200,000	-	22,246,809	46,809

	小計	22,200,000	-	22,246,809	46,809
	合計	22,200,000	-	22,246,809	46,809

(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)

(2023年4月26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	12,191,357,761円
同期中における追加設定元本額	7,866,881,112円
同期中における一部解約元本額	1,543,020,107円
2023年4月26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	9,603,795,290円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	3,137,437,890円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	266,639,650円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	341,756,222円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	213,735,906円
イオン・バランス戦略ファンド	138,659,796円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	45,616,597円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	107,677,981円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	81,183,599円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	361,015,086円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	296,699,876円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	492,667,030円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	112,507,484円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	5,709,321円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	862,226,104円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	2,310,859,323円
三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド	57,707,897円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	39,354円

三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2040	47,702円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2045	59,639円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2055	73,424円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2065	73,424円
三井住友D S ・ F W 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 ・ F W 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 ・ F W 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>	78,786,726円
合 計	18,515,218,766円

(2023年10月26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	18,515,218,766円
同期中における追加設定元本額	3,568,658,970円
同期中における一部解約元本額	1,977,032,660円
2023年10月26日現在の元本の内訳	
三井住友・D C つみたてN I S A ・ 全海外株インデックスファンド	10,873,603,967円
三井住友・D C 新興国株式インデックスファンド	3,283,418,774円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	185,756,430円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	267,916,933円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	166,421,965円
イオン・バランス戦略ファンド	99,725,283円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2050	50,601,966円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	117,541,570円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	88,516,111円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	408,444,118円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	267,259,369円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	382,495,381円
三井住友・D C つみたてN I S A ・ 世界分散ファンド	124,147,300円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2060	5,890,326円
日興F W S ・ 新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	642,083,780円
日興F W S ・ 新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	2,978,625,859円
三井住友D S ・ 新興国株式インデックス・ファンド	68,887,174円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2035	402,125円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2040	309,335円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2045	154,236円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2055	90,066円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2065	93,413円
三井住友D S ・ F W 専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	106,708円
三井住友D S ・ F W 専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	1,720,254円
三井住友D S ・ F W 専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	7,654,021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)	3,668,110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)	1,590,215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>	79,720,287円
合 計	20,106,845,076円

日本国債ダイナミック・アロケーション・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2023年4月26日現在)	(2023年10月26日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	63,655,599	64,325,995
コール・ローン	2,855,964,411	3,719,956,753
国債証券	4,830,406,571	3,335,903,910
未収入金	-	344,755,200
未収利息	5,364,846	3,707,755
前払費用	2,804,946	2,996,232
流動資産合計	7,758,196,373	7,471,645,845
資産合計	7,758,196,373	7,471,645,845
負債の部		
流動負債		
未払金	236,745,000	-
未払解約金	-	3,000,000
その他未払費用	6,430	8,970
流動負債合計	236,751,430	3,008,970
負債合計	236,751,430	3,008,970
純資産の部		
元本等		
元本	6,583,754,367	6,734,607,495
剰余金		
剰余金又は欠損金()	937,690,576	734,029,380
元本等合計	7,521,444,943	7,468,636,875
純資産合計	7,521,444,943	7,468,636,875
負債純資産合計	7,758,196,373	7,471,645,845

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年4月27日 至 2023年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p>

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2023年4月26日現在)	(2023年10月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	6,583,754,367口	6,734,607,495口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1424円 (1万口当たりの純資産額11,424円)	1口当たり純資産額 1.1090円 (1万口当たりの純資産額11,090円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年10月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
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)

(2023年4月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	7,859,603,975円
同期中における追加設定元本額	332,657,815円
同期中における一部解約元本額	1,608,507,423円
2023年4月26日現在の元本の内訳	
イオン・バランス戦略ファンド	740,997,629円
S M A M・年金日本国債ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	5,842,756,738円
合計	6,583,754,367円

(2023年10月26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	6,583,754,367円
同期中における追加設定元本額	640,914,568円
同期中における一部解約元本額	490,061,440円
2023年10月26日現在の元本の内訳	
イオン・バランス戦略ファンド	789,416,823円
S M A M・年金日本国債ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家 限定>	5,945,190,672円
合 計	6,734,607,495円

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

イオン・バランス戦略ファンド

2023年11月30日現在

資産総額	3,033,750,401円
負債総額	18,614,798円
純資産総額（ - ）	3,015,135,603円
発行済口数	3,309,352,923口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	0.9111円 (9,111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11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。

ニ 投資信託の運用の流れ



2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託

の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として投資運用業および投資助言業務を行っています。また、「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業にかかる業務を行っています。

2023年11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	692	11,272,203
単位型株式投資信託	98	669,640
追加型公社債投資信託	1	25,264
単位型公社債投資信託	160	254,725
合 計	951	12,221,833

3【委託会社等の経理状況】

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

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

なお、当中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）は、改正府令附則第3条第1項ただし書きにより、改正後の中間財務諸表等規則に基づいて作成しております。

2 当社は、第38期（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、第39期中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

	（単位：千円）	
	前事業年度 （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 (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		
サービス支助手数料	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		
固定資産除却損	1 83,651	13,203
システム統合関連費用	2 375,636	-
早期退職費用	3 260,075	126,832
支払補償費	4 -	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							
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			
		資本準備金	その他資本 剰余金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金		
					配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金	
当期首残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	10,281,242
当期変動額								
剰余金の配当								
欠損填補			8,460,037	8,460,037				8,460,037
当期純利益								4,119,040
任意積立金の 取崩						60,000	1,476,959	1,536,959
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）								
当期変動額合計	-	-	8,460,037	8,460,037	-	60,000	1,476,959	14,116,037
当期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	-	-	3,834,794

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

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)
その他有価証券 非上場株式	39,809	39,809
合計	39,809	39,809
子会社株式 非上場株式	11,246,398	11,850,598
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 その他有価証券	-	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 その他有価証券

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

(有価証券関係)

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. その他有価証券

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	㈱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㈱	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	㈱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㈱	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いません。

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

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第39期中間会計期間 (2023年9月30日)	
資産の部	
流動資産	
現金及び預金	71,777,366
金銭の信託	12,836,073
顧客分別金信託	300,049
前払費用	544,624
未収委託者報酬	13,133,566
未収運用受託報酬	2,879,922
未収投資助言報酬	463,644
未収収益	67,881
その他	193,812
流動資産合計	102,196,941
固定資産	
有形固定資産	1
無形固定資産	1,897,269
のれん	2,893,139
顧客関連資産	10,388,702
その他	2,893,330
無形固定資産合計	16,175,172
投資その他の資産	
投資有価証券	9,623,355
関係会社株式	1,927,221
繰延税金資産	128,142
その他	1,543,634
貸倒引当金	20,750
投資その他の資産合計	13,201,604
固定資産合計	31,274,046
資産合計	133,470,988
負債の部	
流動負債	
リース債務	2,070
顧客からの預り金	11,882
その他の預り金	161,963
未払金	6,019,407
未払費用	6,744,050
未払法人税等	3,908,872
前受収益	21,118

賞与引当金		2,110,575
資産除去債務		13,940
その他	2	623,468
流動負債合計		19,617,350
固定負債		
リース債務		1,172
退職給付引当金		5,235,679
固定負債合計		5,236,852
負債合計		24,854,202
純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,628,984
その他資本剰余金		73,466,962
資本剰余金合計		82,095,946
利益剰余金		
利益準備金		284,245
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		24,226,602
利益剰余金合計		24,510,847
株主資本合計		108,606,793
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		9,992
評価・換算差額等合計		9,992
純資産合計		108,616,786
負債純資産合計		133,470,988

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

		第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		33,390,366
運用受託報酬		4,611,539
投資助言報酬		646,058
その他の営業収益		137,072
営業収益計		38,785,036
営業費用		26,393,207
一般管理費	1	10,162,729
営業利益		2,229,099
営業外収益	2	11,280,120
営業外費用	3	51,894
経常利益		13,457,325
特別利益	4	14,096,622
特別損失	5	358
税引前中間純利益		27,553,589
法人税、住民税及び事業税		5,843,255
法人税等調整額		716,591
法人税等合計		5,126,663

中間純利益

22,426,926

(3)中間株主資本等変動計算書

第39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金			利益剰余金	
		資本準備金	その他資本 剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金 繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	3,391,568
当中間期変動額						
剰余金の配当						1,591,892
中間純利益						22,426,926
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）						
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	20,835,033
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	24,226,602

	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	3,675,814	87,771,760	142,558	142,558	87,629,201
当中間期変動額					
剰余金の配当	1,591,892	1,591,892			1,591,892
中間純利益	22,426,926	22,426,926			22,426,926
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）			152,551	152,551	152,551
当中間期変動額合計	20,835,033	20,835,033	152,551	152,551	20,987,584
当中間期末残高	24,510,847	108,606,793	9,992	9,992	108,616,786

注記事項

(重要な会計方針)

1. 資産の評価基準及び評価方法

(1)有価証券

子会社株式

移動平均法による原価法

その他有価証券

市場価格のない株式等以外

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

(2)金銭の信託

運用目的の金銭の信託

時価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産（リース資産を除く）

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

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物	8～50年
器具備品	4～15年

(2)無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

のれん	14年
顧客関連資産	6～19年
ソフトウェア（自社利用分）	5年

(3)リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

(1)貸倒引当金

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

(2)賞与引当金

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

(3)退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. 収益及び費用の計上基準

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。

(中間貸借対照表関係)

第39期中間会計期間 (2023年9月30日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	1,963,152千円
2.消費税等の取扱い	
仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。	

3. 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。

当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。

当座借越極度額の総額	10,000,000千円
借入実行残高	-
差引額	10,000,000千円

（中間損益計算書関係）

第39期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）	
1. 一般管理費のうち主要なもの	
のれん償却費	152,270千円
減価償却実施額	
有形固定資産	155,138千円
無形固定資産	1,475,775千円
2. 営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	11,020,394千円
投資有価証券売却益	2,513千円
金銭の信託運用益	190,497千円
3. 営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	1,978千円
投資有価証券償還損	883千円
投資有価証券売却損	48,575千円
4. 特別利益のうち主要なもの	
子会社株式売却益	14,096,622千円
5. 特別損失のうち主要なもの	
固定資産除却損	358千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

1. 発行済株式数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
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）

第39期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）	
1. オペレーティング・リース取引 （借主側）	
未経過リース料（解約不能のもの）	
1年以内	1,161,545千円
1年超	580,772千円
合計	1,742,317千円

（金融商品関係）

1. 金融商品の時価等に関する事項

第39期中間会計期間（2023年9月30日）

2023年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のないものは、次表には含まれておりません（（注1）参照）。また、現金及び預金、顧客分別金信託、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収投資助言報酬、顧客からの預り金、未払金は、短期間で決済されるため時価が帳簿価格に近似することから、注記を省略しております。

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)金銭の信託	12,836,073	12,836,073	-
(2)投資有価証券 その他有価証券	9,582,998	9,582,998	-
資産計	22,419,071	22,419,071	-

(注1) 市場価格のない金融商品

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額
その他有価証券 非上場株式	40,356
合計	40,356
子会社株式 非上場株式	1,927,221
合計	1,927,221

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

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

(単位：千円)

区分	時価			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
(1)金銭の信託	-	12,836,073	-	12,836,073
(2)投資有価証券 その他有価証券	-	9,582,998	-	9,582,998
資産計	-	22,419,071	-	22,419,071

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

(1) 金銭の信託

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

(2) 投資有価証券 その他有価証券

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

(有価証券関係)

第39期中間会計期間（2023年9月30日）

1. 子会社株式

子会社株式（中間貸借対照表計上額 1,927,221千円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

2. その他有価証券

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	3,341,749	3,156,408	185,340
小計	3,341,749	3,156,408	185,340

(2)中間貸借対照表計上額が取得原価を 超えないもの 投資信託等	6,241,249	6,403,283	162,034
小計	6,241,249	6,403,283	162,034
合計	9,582,998	9,559,692	23,306

(注)非上場株式等（中間貸借対照表計上額 40,356千円）については、市場価格がないことから、記載しておりません。

(デリバティブ取引関係)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

(収益認識関係)

第39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

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

(セグメント情報等)

第39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

1. セグメント情報

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

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

2. 関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への 営業収益	33,390,366	4,611,539	646,058	137,072	38,785,036

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
1株当たり純資産額	3,206円86銭
1株当たり中間純利益	662円14銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

イ 受託会社

- (イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社
- (ロ) 資本金の額 342,037百万円（2023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（2023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） 2023年3月末現在	事業の内容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	12,200	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

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7月5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

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」に掲げられているイオン・バランス戦略ファンドの2022年4月27日から2023年4月26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、イオン・バランス戦略ファンドの2023年4月26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。

その他の事項

ファンドの2022年4月26日をもって終了した前計算期間の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して2022年7月12日付けで無限定適正意見を表明している。

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、継続企業的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. XBRL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11月17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 佐藤 栄 裕指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 深井 康 治**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第39期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2023年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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。

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要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、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2024年1月10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 Japan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」に掲げられているイオン・バランス戦略ファンドの2023年4月27日から2023年10月26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、イオン・バランス戦略ファンドの2023年10月26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（2023年4月27日から2023年10月26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2023年4月26日をもって終了した前計算期間の中間計算期間（2022年4月27日から2022年10月26日まで）に係る中間財務諸表は、前任監査人によって中間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2023年1月10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。