

## 【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6月6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】	竹本 政司
【電話番号】	03-6205-0265
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

## (1)【ファンドの名称】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド  
以下「当ファンド」といいます。

## (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

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

## (3)【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

## (4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

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

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

## (5)【申込手数料】

ありません。

## (6)【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

## ( 7 ) 【申込期間】

2024年6月7日から2024年12月5日まで

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

## ( 8 ) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。なお、委託会社においても申込みを取り扱う場合には、委託会社は販売会社としての役割も有します。

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

## ( 9 ) 【払込期日】

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

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

## ( 10 ) 【払込取扱場所】

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

## ( 11 ) 【振替機関に関する事項】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

## ( 12 ) 【その他】

イ 申込証拠金  
ありません。

ロ 日本以外の地域における募集  
ありません。

ハ お申込不可日

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

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

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

ホ 振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、ファンドの振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則に従って取り扱われるものとし、ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法お

よび当該振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。

(参考：投資信託振替制度)

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

イ 当ファンドは、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資を行い、委託会社が独自に作成した合成指数をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ベンチマークの詳細については、後述の「2 投資方針」をご参照ください。

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

ハ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

##### （イ）当ファンドが該当する商品分類

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

##### （ロ）当ファンドが該当する属性区分

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

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

## (2) 【ファンドの沿革】

2017年10月 3日 信託契約締結、設定、運用開始。

## (3) 【ファンドの仕組み】

### イ 当ファンドの関係法人とその役割

#### (イ) 委託会社 「三井住友D Sアセットマネジメント株式会社」

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

#### (ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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

#### (ハ) 販売会社

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

委託会社は販売会社としての役割も有する場合があります。

### ロ 委託会社の概況

#### (イ) 資本金の額

20億円(2024年3月29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

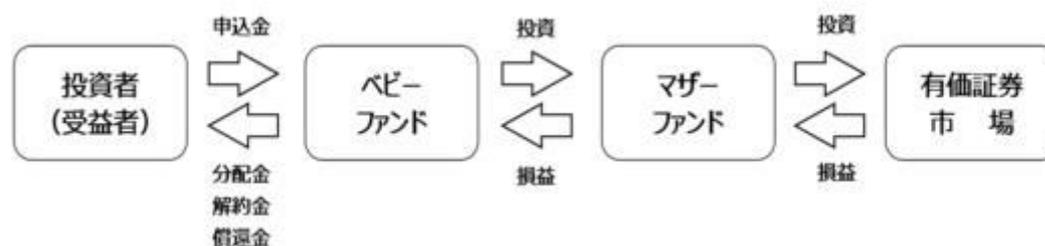
(2024年3月29日現在)

名称	住所	所有 株式数 (株)	比率 (%)

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

## 八 ファンドの運用形態(ファミリーファンド方式による運用)

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



## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### イ 基本方針

世界各国の債券、株式および不動産投資信託(リート)等に分散投資を行い、委託会社が独自に作成した合成指数をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

#### ロ 投資態度

(イ) 以下の各指数の比率に基づいて委託会社が独自に作成した合成指数をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。

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

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

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



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

- (八) 実質組入外貨建資産については、マザーファンド受益証券で対円での為替ヘッジを行っている場合を除き、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (二) 資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## ファンドの特色

**1** マザーファンドへの投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に分散投資します。

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

株式 ■ 国内株式 ■ 先進国株式(除く日本) ■ 新興国株式

リート ■ 国内リート ■ 外国リート

**2** 各マザーファンドが連動の対象とする指数を基本資産配分比率で組み合わせた合成指数をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。

[各マザーファンドの対象指数と基本資産配分比率]

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

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

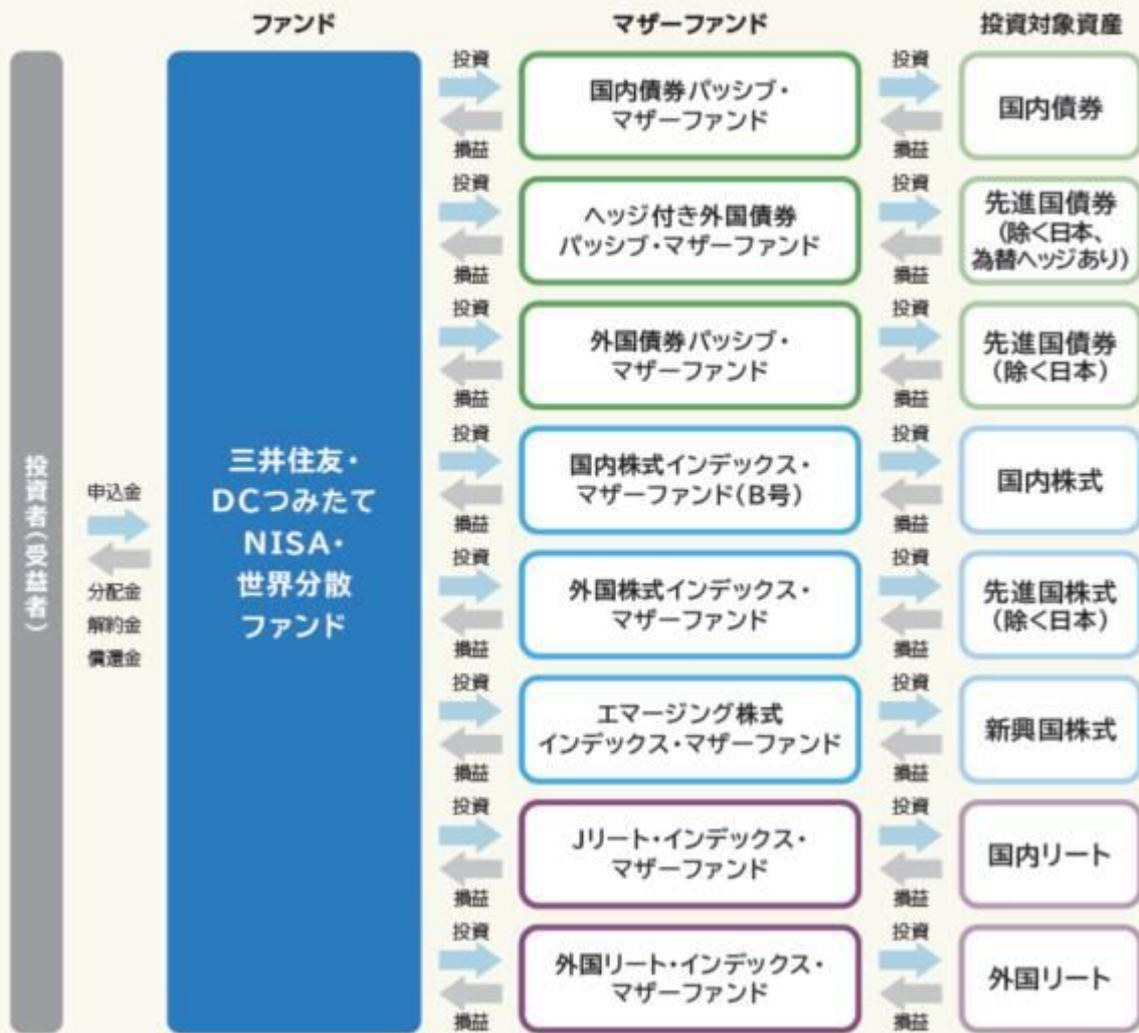
※資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

### 指数の著作権など

- NOMURA-BPIは野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社、FTSE世界国債インデックスはFTSE Fixed Income LLC、TOPIX(東証株価指数)および東証REIT指数は株式会社JPX総研、MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスはMSCI Inc.、S&P先進国REIT指数はS&P Dow Jones Indices LLCが、それぞれ公表している指数です。
- 各インデックスに関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は、指数を公表および許諾する各社に帰属します。また、当該各社は当ファンドの取引および運用成果等に関して一切責任を負いません。

## ファンドのしくみ

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



## 各マザーファンドの投資方針等

## ▶ 債券

## 国内債券

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

## 先進国債券(除く日本、為替ヘッジあり)…為替ヘッジあり

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

## 先進国債券(除く日本)…為替ヘッジなし

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

## ▶ 株式

## 国内株式

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

## 先進国株式(除く日本)…為替ヘッジなし

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

## 新興国株式…為替ヘッジなし

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

## ▶リート

## 国内リート

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

## 外国リート…為替ヘッジなし

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

## (2)【投資対象】

## イ 投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

(ロ)特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1. 為替手形

## ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として、国内債券パッシブ・マザーファンド、ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド、外国債券パッシブ・マザーファンド、国内株式インデックス・マザーファンド(B号)、外国株式インデックス・マザーファンド、エマージング株式インデックス・マザーファンド、Jリート・インデックス・マザーファンド、外国リート・インデックス・マザーファンドの受益証券または次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

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

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

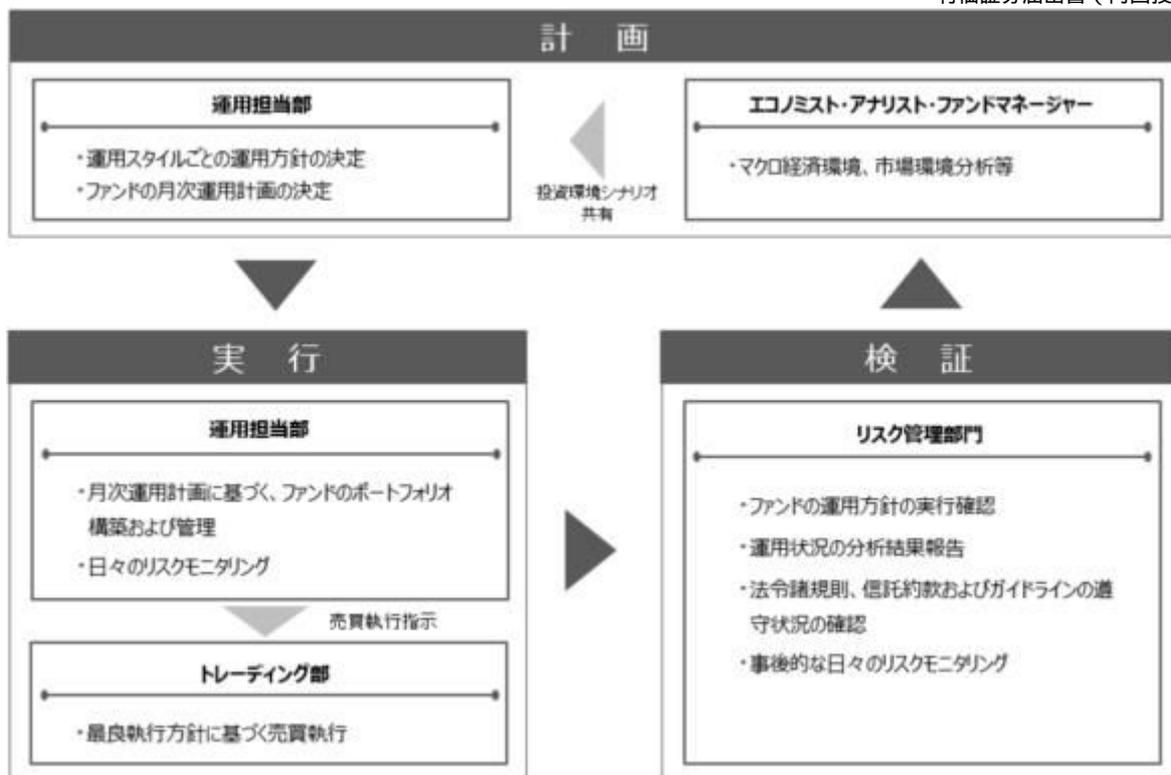
#### 八 投資対象とする金融商品

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

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

### (3) 【運用体制】

#### イ ファンドの運用体制



リスク管理部門の人員数は、約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。

□ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

（４）【分配方針】

年1回（原則として毎年9月10日。ただし、休業日の場合は翌営業日となります。）決算を行い、原則として以下の方針に基づき分配金額を決定します。

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

- イ 株式への実質投資割合には制限を設けません。

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



率を合計したものをいいます（以下同じ。）。

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

ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

#### イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

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

#### ロ 投資する株式等の範囲

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

#### ハ 信用取引の指図

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

#### ニ 先物取引等の指図

- （イ）委託会社は、日本の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします（以下同じ。）。
- （ロ）委託会社は、日本の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。
- （ハ）委託会社は、日本の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国

の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

#### ホ スワップ取引の指図

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

#### ヘ 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図

- (イ) 委託会社は、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかに、その超える額に相当する金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 上記(ハ)においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ホ) 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ヘ) 委託会社は、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- (ト) 「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」とい

います。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

- (チ)「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間にかかる為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下同じ。)を取り決め、その取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- (リ)「直物為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金の授受を約する取引、その他これに類似する取引をいいます。

#### ト 有価証券の貸付けの指図

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

#### チ 有価証券の空売りの指図

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

#### リ 有価証券の借入れの指図

- (イ)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- (ロ)上記(イ)の指図は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超え

ない範囲で行うものとします。

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

(二) 借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

ヌ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ル 外国為替予約取引の指図

(イ) 委託会社は、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

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

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

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

ヲ 資金の借入れ

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

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

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

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

(二) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

法令に基づく投資制限

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

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

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

号)

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

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

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

（参考情報：マザーファンドの投資方針等）

（国内債券パッシブ・マザーファンド）

（1）投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

（ロ）公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

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

（2）投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

1．株券または新株引受権証書

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

9．特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10．コマースナル・ペーパー

11．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）お

## よび新株予約権証券

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

## 八 投資対象とする金融商品

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

## (3) 投資制限

## イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

## (ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド)

## (1) 投資方針等

## イ 基本方針

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

## ロ 投資態度

- (イ) F T S E 世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ換算ベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きと連動する投資成果を目指します。
- (ロ) ポートフォリオ構築にあたっては、取引コストを極力抑えながら、推定トラッキングエラーを

最小化します。

- (ハ) ベンチマークの月次の変化状況とポートフォリオのリスク量の状況を勘案しながらリバランスを行います。
- (ニ) 保有する外貨建て資産については、対円での為替のフルヘッジを原則とします。
- (ホ) 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。
- (ヘ) 資金動向、市況動向等の急変により上記の運用が困難となった場合、暫定的に上記と異なる運用を行う場合があります。

## (2) 投資対象

### イ 投資対象とする資産の種類

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

### ロ 投資対象とする有価証券

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

### ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載したベビー

ファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

### （３）投資制限

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

### （外国債券パッシブ・マザーファンド）

#### （１）投資方針等

##### イ 基本方針

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

##### ロ 投資態度

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

#### （２）投資対象

##### イ 投資対象とする資産の種類

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

##### ロ 投資対象とする有価証券

- １．株券または新株引受権証券
- ２．国債証券



3. 地方債証券
  4. 特別の法律により法人の発行する債券
  5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
  6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
  7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
  8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
  9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
  10. コマーシャル・ペーパー
  11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
  12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
  13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
  14. 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
  15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
  16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
  17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
  18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
  20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  21. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- 八 投資対象とする金融商品
- 前記「2 投資方針（2）投資対象 八 投資対象とする金融商品」において記載したベビーフンドが投資対象とする金融商品に同じです。

### （3）投資制限

#### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- （イ）株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- （ロ）投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- （ハ）外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- （ニ）同一発行体の発行する債券への投資割合は、国債を除き、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- （ホ）同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- （ヘ）一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなっ

た場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

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

## (国内株式インデックス・マザーファンド(B号))

### (1) 投資方針等

#### イ 基本方針

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

#### ロ 投資態度

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

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

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

### (2) 投資対象

#### イ 投資対象とする資産の種類

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

#### ロ 投資対象とする有価証券

1. 株券または新株引受権証書

2. 国債証券

3. 特別の法律により法人の発行する債券

4. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

#### ハ 投資対象とする金融商品

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

### (3) 投資制限

#### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 外貨建資産への投資は行いません。

(ロ) 株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

## (外国株式インデックス・マザーファンド)

### (1) 投資方針等

#### イ 基本方針

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

#### ロ 投資態度

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

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

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

### (2) 投資対象

#### イ 投資対象とする資産の種類

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

#### ロ 投資対象とする有価証券

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

#### ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載したベビー

ファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

### （３）投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）株式への投資割合には制限を設けません。

（ロ）外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

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

### （エマーシング株式インデックス・マザーファンド）

#### （１）投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

（イ）主として新興国の株式（預託証書（D R）、株式の値動きに連動する有価証券を含みます。）、新興国の株式指数を対象とした先物取引および新興国の株式等を主要投資対象とする上場投資信託証券に投資し、M S C Iエマーシング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

（ロ）運用にあたっては、ファンドの資産規模、市況動向に応じて株式、株価指数先物取引、上場投資信託証券、短期公社債等および為替取引を組み合わせ運用を行います。

（ハ）外貨建資産について円に対する為替ヘッジは原則として行いません。

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

#### （２）投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

１．株券または新株引受権証書

２．国債証券

３．地方債証券

４．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

をいいます。）

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

#### 八 投資対象とする金融商品

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

#### （3）投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

（Jリート・インデックス・マザーファンド）

（1）投資方針等

## イ 基本方針

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

## ロ 投資態度

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

## （2）投資対象

### イ 投資対象とする資産の種類

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

### ロ 投資対象とする有価証券

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

### ハ 投資対象とする金融商品

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

## （3）投資制限

### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

（外国リート・インデックス・マザーファンド）

### （１）投資方針等

#### イ 基本方針

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

#### ロ 投資態度

- （イ）S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
- （ロ）不動産投資信託（REIT）などへの投資にあたっては、S & P先進国REIT指数（除く日本）採用銘柄（採用予定を含みます。）に投資を行うものとします。
- （ハ）不動産投資信託（REIT）の組入比率は、原則として高位を保ちます。
- （ニ）外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを行わないものとします。
- （ホ）資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

### （２）投資対象

#### イ 投資対象とする資産の種類

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

#### ロ 投資対象とする有価証券

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

#### ハ 投資対象とする金融商品

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

### （３）投資制限

#### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

## 3【投資リスク】

## イ ファンドのもつリスクの特性

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

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

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

当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

### (イ) 株式市場リスク

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

### (ロ) 債券市場リスク

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

### (ハ) 不動産投資信託(リート)に関するリスク

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

### (ニ) 信用リスク

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

### (ホ) 為替変動リスク

ファンドは外貨建資産の一部について、原則として対円での為替ヘッジを行います。為替ヘッジが行われていない部分については為替変動の影響を受けます。ファンドが保有する外貨建資産の価格が現地通貨ベースで上昇する場合であっても、当該現地通貨が対円で下落する(円高となる)場合、円ベースでの評価額が下落し、基準価額が下落することがあります。為替ヘッジが行われている部分については為替変動の影響を受けますが、原則として対円での為替ヘッジを行うため、その影響は限定的と考えられます。ただし、完全に為替変動リスクを回避することはできません。なお、円金利がヘッジ対象通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当分のヘッジコストがかかることにご留意ください。また、需給要因等によっては金利差相当分以上にヘッジコストがかかる場合があります。

### (ヘ) カントリーリスク

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

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

### (ト) 流動性リスク

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



基準価額が下落する要因となります。

## □ その他の留意点

### （イ）ファンド固有の留意点

合成指数の動きと連動しない要因

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

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

### （ロ）投資信託に関する留意点

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

### （ハ）分配金に関する留意事項

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



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

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

## 八 投資リスクの管理体制

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

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

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

さらに、流動性リスク管理について規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング

ヤストレストテストを実施するとともに、緊急時対応策等の策定や有効性の検証等を行います。なお、当該流動性リスクの適切な管理の実施等について、定期的にはリスク管理会議へ報告します。コンプライアンス担当部は、法令・諸規則等の遵守状況の確認等を行い、結果をコンプライアンス会議に報告します。

## （参考情報）投資リスクの定量的比較

### 「ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移」

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



### 「ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較」

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



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

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

## 各資産クラスの指数

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

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

## 4 【手数料等及び税金】

## ( 1 ) 【申込手数料】

ありません。

## ( 2 ) 【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

## ( 3 ) 【信託報酬等】

純資産総額に年0.231%（税抜き0.21%）の率を乗じて得た金額が、毎日信託財産の費用として計上され、ファンドの基準価額に反映されます。また、信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

信託報酬の配分は以下の通りです。

< 信託報酬の配分（税抜き） >

支払先	料率	役務の内容
委託会社	年0.09%	ファンドの運用およびそれに伴う調査、受託会社への指図、基準価額の算出、法定書面等の作成等の対価
販売会社	年0.10%	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年0.02%	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価

上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。

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

## ( 4 ) 【その他の手数料等】

- イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用（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、マザーファンドの購入・換金に伴う信託財産留保額等（それらにかかる消費税等相当額を含みます。）は、信託財産中から支弁するものとします。

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

## ( 5 ) 【課税上の取扱い】

- イ 個別元本について

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

#### ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

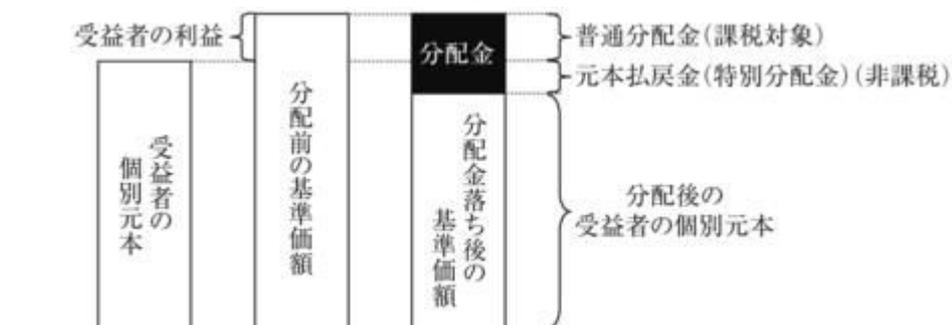
#### ハ 収益分配金の課税について

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

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



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



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

## 二 個人、法人別の課税の取扱いについて

### (イ) 個人の受益者に対する課税

・収益分配時

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

・一部解約時および償還時

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

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

（ロ）法人の受益者に対する課税

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

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

なお、当ファンドは、配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

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

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

課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家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「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」および「つみたて投資枠（特定累積投資勘定）」の対象ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、少額上場株式等に関する非課税制度であり、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たした公募株式投資信託等を購入するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

上記「（5）課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2024年3月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

**(参考情報)総経費率**

直近の運用報告書の対象期間(2022年9月13日～2023年9月11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。

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
0.27%	0.23%	0.04%

※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。)です。

※当ファンドが上場投資信託(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】**

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

2024年3月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	2,727,219,009	99.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	26,769,697	0.97
合計(純資産総額)		2,753,988,706	100.00

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

**(2)【投資資産】****【投資有価証券の主要銘柄】**

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

**イ 主要投資銘柄**

2024年3月29日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	外国株式イン デックス・マ ザーファンド	62,575,771	7.3035	457,023,844	8.8379	553,038,406	20.08
日本	親投資 信託受 益証券	外国債券パッシ ブ・マザーファ ンド	239,730,704	2.1187	507,908,415	2.2629	542,486,610	19.70
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	123,321,516	2.9708	366,360,425	3.3461	412,646,124	14.98
日本	親投資 信託受 益証券	国内債券パッシ ブ・マザーファ ンド	333,174,566	1.2122	403,884,686	1.2135	404,307,335	14.68

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)	55,838,024	4.1225	230,190,424	4.9290	275,225,620	9.99
日本	親投資 信託受 益証券	エマージング株 式インデック ス・マザーファ ンド	135,091,162	1.8187	245,683,564	2.0142	272,100,618	9.88
日本	親投資 信託受 益証券	Jリート・イン デックス・マ ザーファンド	52,646,694	2.6512	139,576,068	2.6155	137,697,428	5.00
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	106,038,477	1.2160	128,940,784	1.2233	129,716,868	4.71

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

2024年3月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.03
合計	99.03

#### 【投資不動産物件】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

該当事項はありません。

#### (3) 【運用実績】

##### 【純資産の推移】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2018年 9月10日)	115,063,603	115,063,603	10,051	10,051
第2期 (2019年 9月10日)	295,583,344	295,583,344	10,442	10,442
第3期 (2020年 9月10日)	544,780,618	544,780,618	10,720	10,720
第4期 (2021年 9月10日)	1,014,406,357	1,014,406,357	12,869	12,869
第5期 (2022年 9月12日)	1,634,445,391	1,634,445,391	13,461	13,461
第6期 (2023年 9月11日)	2,217,351,256	2,217,351,256	14,055	14,055

2023年 3月末日	1,853,892,088	-	12,865	-
4月末日	1,918,543,803	-	13,052	-
5月末日	1,991,216,893	-	13,365	-
6月末日	2,123,916,000	-	13,995	-
7月末日	2,173,661,530	-	14,027	-
8月末日	2,231,517,621	-	14,151	-
9月末日	2,222,981,199	-	13,856	-
10月末日	2,205,503,198	-	13,518	-
11月末日	2,354,113,724	-	14,231	-
12月末日	2,428,774,076	-	14,469	-
2024年 1月末日	2,529,865,391	-	14,753	-
2月末日	2,640,244,817	-	15,094	-
3月末日	2,753,988,706	-	15,494	-

## 【分配の推移】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2017年10月3日～2018年9月10日	0
第2期	2018年9月11日～2019年9月10日	0
第3期	2019年9月11日～2020年9月10日	0
第4期	2020年9月11日～2021年9月10日	0
第5期	2021年9月11日～2022年9月12日	0
第6期	2022年9月13日～2023年9月11日	0

## 【収益率の推移】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

	収益率(%)
第1期	0.5
第2期	3.9
第3期	2.7
第4期	20.0
第5期	4.6
第6期	4.4
第7期(中間期)	7.0

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

## (4) 【設定及び解約の実績】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)



第1期	134,068,987	19,587,428
第2期	198,345,231	29,755,343
第3期	284,669,114	59,535,952
第4期	357,578,274	77,546,767
第5期	503,710,231	77,728,393
第6期	492,057,391	128,687,266
第7期(中間期)	272,113,185	95,647,894

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

(参考)

(1) 投資状況

国内債券パッシブ・マザーファンド

2024年3月29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	106,939,153,810	79.87
地方債証券	日本	8,623,151,300	6.44
特殊債券	日本	10,456,381,743	7.81
社債券	日本	7,072,401,600	5.28
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	796,159,138	0.60
合計(純資産総額)		133,887,247,591	100.00

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2024年3月29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	9,879,918,226	46.11
	中国	1,841,243,533	8.59
	フランス	1,664,687,843	7.77
	イタリア	1,515,163,317	7.07
	ドイツ	1,308,112,949	6.10
	イギリス	1,086,614,533	5.07
	スペイン	1,017,586,331	4.75
	カナダ	430,693,338	2.01
	ベルギー	371,134,546	1.73
	オランダ	310,575,461	1.45
	オーストラリア	283,348,498	1.32
	オーストリア	254,583,357	1.19
	シンガポール	193,124,968	0.90
	メキシコ	183,686,755	0.86
	ポーランド	116,335,104	0.54
	フィンランド	112,781,046	0.53
	アイルランド	108,950,016	0.51
イスラエル	69,395,949	0.32	
デンマーク	56,805,427	0.27	

	ニュージーランド	51,725,456	0.24
	スウェーデン	41,530,678	0.19
	ノルウェー	33,084,267	0.15
	小計	20,931,081,598	97.68
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	496,885,518	2.32
合計(純資産総額)		21,427,967,116	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	-	58,490,824	0.27
為替予約取引	売建	-	21,401,052,319	99.87

### 外国債券パッシブ・マザーファンド

2024年3月29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	85,506,812,923	46.40
	中国	15,641,592,315	8.49
	フランス	14,420,025,692	7.83
	イタリア	13,128,229,217	7.12
	ドイツ	11,400,735,469	6.19
	イギリス	9,413,216,674	5.11
	スペイン	8,813,232,512	4.78
	カナダ	3,727,013,883	2.02
	ベルギー	3,176,721,980	1.72
	オランダ	2,681,541,194	1.46
	オーストラリア	2,478,977,991	1.35
	オーストリア	2,173,555,846	1.18
	メキシコ	1,573,974,105	0.85
	ポーランド	1,013,465,796	0.55
	フィンランド	934,522,228	0.51
	アイルランド	926,771,266	0.50
	マレーシア	896,581,094	0.49
	シンガポール	749,079,265	0.41
	イスラエル	567,753,729	0.31
	デンマーク	484,535,641	0.26
ニュージーランド	450,094,790	0.24	
スウェーデン	347,957,230	0.19	
ノルウェー	304,497,693	0.17	
小計	180,810,888,533	98.12	
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	3,455,587,425	1.88
合計(純資産総額)		184,266,475,958	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	-	1,403,909,572	0.76
為替予約取引	売建	-	642,531,764	0.35

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

2024年3月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	330,757,661,580	98.20
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	6,066,860,513	1.80
合計（純資産総額）		336,824,522,093	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	5,983,200,000	1.78
合計	買建	-	5,983,200,000	1.78

## 外国株式インデックス・マザーファンド

2024年3月29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	525,923,331,426	69.82
	イギリス	27,172,496,844	3.61
	カナダ	24,511,641,063	3.25
	フランス	22,434,090,965	2.98
	スイス	21,822,026,182	2.90
	ドイツ	17,672,181,781	2.35
	オランダ	15,086,616,164	2.00
	アイルランド	13,755,271,821	1.83
	オーストラリア	13,065,731,279	1.73
	デンマーク	7,420,735,936	0.99
	スウェーデン	6,291,810,222	0.84
	スペイン	5,266,826,254	0.70
	イタリア	4,089,751,686	0.54
	香港	2,774,164,276	0.37
	ジャージー	2,238,786,729	0.30
	シンガポール	2,138,213,858	0.28
	フィンランド	1,974,327,678	0.26
	ベルギー	1,540,836,392	0.20
	イスラエル	1,520,162,524	0.20
	ノルウェー	1,207,895,072	0.16
	オランダ領キュ ラソー	947,231,287	0.13
	バミューダ	932,944,274	0.12
ケイマン諸島	880,986,638	0.12	
ニュージーラン ド	524,103,020	0.07	
リベリア	404,827,693	0.05	

	ルクセンブルグ	396,149,761	0.05
	オーストリア	368,752,137	0.05
	ポルトガル	301,792,091	0.04
	パナマ	209,835,651	0.03
	マン島	64,282,023	0.01
	小計	722,937,802,727	95.97
投資証券	アメリカ	12,191,475,200	1.62
	オーストラリア	1,379,004,580	0.18
	フランス	282,921,903	0.04
	シンガポール	240,974,803	0.03
	イギリス	229,589,520	0.03
	香港	123,259,815	0.02
	ベルギー	60,587,247	0.01
	カナダ	57,834,680	0.01
	ケイマン諸島	48,734,479	0.01
	小計	14,614,382,227	1.94
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	15,749,227,327	2.09
合計（純資産総額）		753,301,412,281	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	641,535,451	0.09
株価指数先物取引	買建	ドイツ	2,264,750,950	0.30
株価指数先物取引	買建	アメリカ	12,418,091,768	1.65
株価指数先物取引	買建	オーストラリア	470,428,866	0.06
合計	買建	-	15,794,807,035	2.10

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率 （％）
為替予約取引	買建	-	2,781,814,425	0.37

#### エマージング株式インデックス・マザーファンド

2024年3月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
株式	インド	7,364,172,117	16.58
	台湾	7,032,356,941	15.83
	ケイマン諸島	5,778,249,037	13.01
	韓国	5,271,400,904	11.87
	中国	2,467,321,826	5.56
	ブラジル	2,055,871,316	4.63
	南アフリカ	1,055,313,406	2.38
	メキシコ	815,679,650	1.84
	インドネシア	769,336,136	1.73
	タイ	620,421,985	1.40
	マレーシア	557,534,387	1.26
	ポーランド	375,363,760	0.85

	香港	326,407,187	0.73
	トルコ	283,563,753	0.64
	フィリピン	261,129,029	0.59
	ギリシャ	213,295,911	0.48
	チリ	195,763,091	0.44
	バミューダ	167,082,904	0.38
	アメリカ	147,137,771	0.33
	ハンガリー	100,332,856	0.23
	チェコ	56,899,106	0.13
	イギリス	51,564,511	0.12
	コロンビア	48,237,215	0.11
	ルクセンブルグ	40,585,509	0.09
	エジプト	29,922,534	0.07
	オランダ	27,654,071	0.06
	ペルー	18,020,909	0.04
	シンガポール	7,113,832	0.02
	小計	36,137,731,654	81.37
投資信託受益証券	香港	1,747,259,884	3.93
投資証券	アメリカ	2,957,667,730	6.66
	メキシコ	298,039,617	0.67
	ブラジル	97,925,459	0.22
	小計	3,353,632,806	7.55
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	3,173,581,272	7.15
合計（純資産総額）		44,412,205,616	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	3,224,230,527	7.26
合計	買建	-	3,224,230,527	7.26

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	-	96,254,061	0.22
為替予約取引	売建	-	482,441	0.00

## Jリート・インデックス・マザーファンド

2024年3月29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	15,030,815,000	98.67
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	203,163,680	1.33
合計（純資産総額）		15,233,978,680	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
リート指数先物取引	買建	日本	35,720,000	0.23
合計	買建	-	35,720,000	0.23

## 外国リート・インデックス・マザーファンド

2024年3月29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	27,096,845,175	75.59
	オーストラリア	2,684,770,433	7.49
	イギリス	1,693,064,822	4.72
	シンガポール	1,109,211,842	3.09
	フランス	622,952,666	1.74
	カナダ	520,326,966	1.45
	ベルギー	368,937,295	1.03
	香港	332,363,605	0.93
	スペイン	142,015,660	0.40
	ニュージーランド	103,234,826	0.29
	ガーンジー	75,439,245	0.21
	韓国	60,112,010	0.17
	オランダ	59,778,581	0.17
	イスラエル	38,881,874	0.11
	ドイツ	13,502,866	0.04
	アイルランド	10,523,371	0.03
イタリア	1,954,880	0.01	
小計		34,933,916,117	97.45
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	915,540,027	2.55
合計（純資産総額）		35,849,456,144	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	-	76,243,768	0.21

## (2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

国内債券パッシブ・マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2024年3月29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	150 5年国債	3,130,000,000	99.88	3,126,305,000	99.50	3,114,318,700	0.005	2026/12/20	2.33
日本	国債 証券	165 5年国債	1,510,000,000	99.71	1,505,656,200	99.77	1,506,481,700	0.300	2028/12/20	1.13
日本	国債 証券	147 5年国債	1,310,000,000	100.16	1,312,030,500	99.68	1,305,755,600	0.005	2026/03/20	0.98
日本	国債 証券	149 5年国債	1,290,000,000	100.09	1,291,134,100	99.56	1,284,285,300	0.005	2026/09/20	0.96

日本	国債 証券	156 5年国債	1,280,000,000	100.26	1,283,269,000	99.82	1,277,632,000	0.200	2027/12/20	0.95
日本	国債 証券	153 5年国債	1,200,000,000	99.89	1,198,645,200	99.33	1,191,936,000	0.005	2027/06/20	0.89
日本	国債 証券	160 5年国債	1,190,000,000	99.89	1,188,711,300	99.62	1,185,525,600	0.200	2028/06/20	0.89
日本	国債 証券	145 5年国債	1,180,000,000	100.37	1,184,377,800	100.01	1,180,165,200	0.100	2025/09/20	0.88
日本	国債 証券	148 5年国債	1,180,000,000	100.12	1,181,409,400	99.61	1,175,433,400	0.005	2026/06/20	0.88
日本	国債 証券	154 5年国債	1,180,000,000	100.16	1,181,907,400	99.55	1,174,713,600	0.100	2027/09/20	0.88
日本	国債 証券	368 10年国債	1,190,000,000	96.98	1,154,102,100	96.74	1,151,158,400	0.200	2032/09/20	0.86
日本	国債 証券	366 10年国債	1,170,000,000	96.45	1,128,408,200	97.22	1,137,438,900	0.200	2032/03/20	0.85
日本	国債 証券	361 10年国債	1,160,000,000	98.28	1,139,991,900	97.72	1,133,505,600	0.100	2030/12/20	0.85
日本	国債 証券	373 10年国債	1,140,000,000	98.93	1,127,763,300	98.86	1,127,049,600	0.600	2033/12/20	0.84
日本	国債 証券	360 10年国債	1,150,000,000	98.52	1,132,952,200	97.92	1,126,103,000	0.100	2030/09/20	0.84
日本	国債 証券	359 10年国債	1,130,000,000	98.78	1,116,257,000	98.12	1,108,744,700	0.100	2030/06/20	0.83
日本	国債 証券	369 10年国債	1,110,000,000	100.92	1,120,223,100	99.01	1,098,977,700	0.500	2032/12/20	0.82
日本	国債 証券	367 10年国債	1,110,000,000	98.47	1,093,012,700	96.98	1,076,478,000	0.200	2032/06/20	0.80
日本	国債 証券	370 10年国債	1,070,000,000	100.51	1,075,461,600	98.77	1,056,839,000	0.500	2033/03/20	0.79
日本	国債 証券	455 2年国債	1,030,000,000	99.94	1,029,344,900	99.78	1,027,682,500	0.005	2025/12/01	0.77
日本	国債 証券	365 10年国債	1,040,000,000	97.98	1,018,940,600	96.67	1,005,336,800	0.100	2031/12/20	0.75
日本	国債 証券	362 10年国債	1,030,000,000	98.43	1,013,829,000	97.47	1,003,951,300	0.100	2031/03/20	0.75
日本	国債 証券	363 10年国債	1,030,000,000	98.04	1,009,814,000	97.21	1,001,283,600	0.100	2031/06/20	0.75
日本	国債 証券	146 5年国債	1,000,000,000	100.40	1,003,980,000	99.92	999,220,000	0.100	2025/12/20	0.75

日本	国債証券	358 10年国債	1,010,000,000	99.00	999,889,000	98.28	992,628,000	0.100	2030/03/20	0.74
日本	国債証券	371 10年国債	1,010,000,000	97.52	984,910,600	97.66	986,315,500	0.400	2033/06/20	0.74
日本	国債証券	372 10年国債	970,000,000	101.40	983,591,900	101.02	979,913,400	0.800	2033/09/20	0.73
日本	国債証券	158 5年国債	980,000,000	100.09	980,925,200	99.31	973,267,400	0.100	2028/03/20	0.73
日本	国債証券	364 10年国債	980,000,000	97.58	956,329,200	96.94	950,051,200	0.100	2031/09/20	0.71
日本	国債証券	147 20年国債	840,000,000	109.59	920,589,500	108.29	909,627,600	1.600	2033/12/20	0.68

## □ 種類別投資比率

2024年3月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	79.87
地方債証券	6.44
特殊債券	7.81
社債券	5.28
合計	99.41

## 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)

2024年3月29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	1,190,000	15,095.97	179,641,990	14,961.73	178,044,593	4.000	2027/01/15	0.83
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,020,000	14,170.37	144,537,762	14,342.46	146,293,129	3.500	2033/02/15	0.68
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	940,000	14,313.63	134,548,101	14,659.82	137,802,298	3.625	2030/03/31	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	930,000	13,516.30	125,701,587	14,556.56	135,375,983	4.125	2053/08/15	0.63
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	6,400,000	2,084.75	133,424,236	2,094.32	134,036,758	2.300	2026/05/15	0.63
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	6,200,000	2,085.61	129,308,077	2,128.01	131,936,310	2.670	2033/05/25	0.62
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000	2,069.91	124,194,566	2,087.80	125,268,290	2.180	2026/08/15	0.58



アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	820,000	14,934.48	122,462,709	15,019.42	123,159,225	4.250	2025/05/31	0.57
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	5,600,000	2,117.23	118,564,650	2,134.42	119,527,540	2.800	2030/03/25	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	850,000	13,707.86	116,516,829	13,903.07	118,176,110	1.250	2026/12/31	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	800,000	14,329.05	114,632,420	14,742.34	117,938,699	3.875	2033/08/15	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	800,000	14,440.73	115,525,830	14,690.25	117,522,019	3.500	2028/04/30	0.55
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	5,600,000	2,085.81	116,805,093	2,089.74	117,025,548	2.180	2025/08/25	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	770,000	14,836.38	114,240,122	14,962.34	115,209,988	4.000	2030/02/28	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	750,000	15,022.71	112,670,332	15,120.56	113,404,197	4.500	2026/07/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	730,000	14,971.72	109,293,582	15,040.01	109,792,069	4.125	2032/11/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	730,000	14,644.47	106,904,626	14,762.63	107,767,172	3.625	2028/03/31	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	710,000	14,780.80	104,943,700	14,842.87	105,384,403	3.625	2026/05/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	700,000	14,835.76	103,850,302	14,963.55	104,744,832	3.875	2025/04/30	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	720,000	14,100.06	101,520,405	14,186.66	102,143,971	3.375	2033/05/15	0.48
フランス	国債証券	FRANCE OAT.	690,000	13,912.49	95,996,155	14,738.94	101,698,683	2.500	2043/05/25	0.47
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	4,800,000	2,087.01	100,176,639	2,093.10	100,468,580	2.280	2025/11/25	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	710,000	13,695.68	97,239,296	13,839.78	98,262,455	0.625	2026/07/31	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	650,000	14,743.03	95,829,707	14,899.65	96,847,740	3.875	2027/12/31	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	700,000	13,628.58	95,400,084	13,749.84	96,248,914	2.875	2032/05/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	640,000	14,860.22	95,105,399	14,955.22	95,713,407	4.000	2026/02/15	0.45
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	4,400,000	2,109.48	92,817,289	2,112.67	92,957,690	2.640	2028/01/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	650,000	13,873.40	90,177,070	14,296.28	92,925,843	0.250	2025/06/30	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	620,000	14,554.29	90,236,574	14,749.45	91,446,613	3.000	2025/09/30	0.43
イギリス	国債証券	UK GILT	500,000	17,680.03	88,400,164	18,242.39	91,211,940	3.250	2033/01/31	0.43

## □ 種類別投資比率

2024年3月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	97.68
合計	97.68

## 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)

2024年3月29日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,450,000	14,234.81	1,629,885,876	14,232.99	1,629,677,839	1.625	2026/05/15	0.88
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,200,000	14,473.13	1,186,796,700	14,461.32	1,185,828,281	2.250	2026/03/31	0.64
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	55,000,000	2,092.78	1,151,028,375	2,099.32	1,154,627,831	2.390	2026/11/15	0.63
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	50,000,000	2,097.89	1,048,943,061	2,112.59	1,056,295,733	2.690	2026/08/12	0.57
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	38,700,000	2,377.37	920,042,571	2,510.03	971,382,200	3.720	2051/04/12	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,200,000	13,257.76	954,558,894	13,216.88	951,615,483	0.625	2027/12/31	0.52
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	43,000,000	2,143.09	921,526,666	2,171.83	933,886,653	3.020	2031/05/27	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	15,082.03	904,921,548	14,742.34	884,540,248	3.875	2033/08/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,100,000	14,645.28	893,362,303	14,342.46	874,890,283	3.500	2033/02/15	0.47
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	41,000,000	2,075.85	851,098,063	2,095.41	859,117,058	2.400	2028/07/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,600,000	15,355.55	859,910,686	15,040.01	842,240,533	4.125	2032/11/15	0.46
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	39,000,000	2,074.97	809,239,904	2,089.74	814,999,358	2.180	2025/08/25	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	14,987.17	794,319,874	14,926.75	791,118,007	3.875	2026/01/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	13,997.10	797,834,554	13,749.84	783,741,160	2.875	2032/05/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,900,000	13,291.83	784,217,950	13,249.74	781,734,523	0.750	2028/01/31	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	14,495.08	797,229,671	14,186.66	780,266,452	3.375	2033/05/15	0.42

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	14,420.29	764,275,285	14,296.28	757,703,031	2.750	2028/02/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	15,145.09	757,254,403	14,966.42	748,321,213	4.000	2028/02/29	0.41
フランス	国債証券	FRANCE OAT.	4,600,000	16,255.50	747,753,141	16,196.51	745,039,439	2.500	2026/09/24	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,900,000	15,110.76	740,427,335	14,961.73	733,124,797	4.000	2027/01/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	15,278.80	733,382,194	15,192.33	729,231,743	4.625	2026/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	12,584.44	717,313,202	12,419.71	707,923,359	1.125	2031/02/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	12,941.32	711,772,353	12,763.86	702,012,465	1.625	2031/05/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,500,000	15,858.69	713,641,031	15,480.46	696,620,754	4.500	2033/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	14,006.79	700,339,384	13,879.15	693,957,453	2.375	2029/03/31	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	14,444.21	693,322,136	14,351.40	688,867,048	2.625	2027/05/31	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	12,982.20	688,056,399	12,791.42	677,945,239	1.875	2032/02/15	0.37
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	32,000,000	2,083.72	666,791,147	2,111.67	675,735,995	2.600	2030/09/15	0.37
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	31,500,000	2,096.09	660,269,868	2,112.67	665,492,556	2.640	2028/01/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,500,000	14,732.80	662,975,938	14,777.31	664,979,093	2.625	2025/04/15	0.36

□ 種類別投資比率

2024年3月29日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.12
合計	98.12

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）

2024年3月29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	4,636,000	2,799.89	12,980,269,236	3,792.00	17,579,712,000	5.22
日本	株式	三菱UFJ フィナンシャル・グループ	銀行業	5,063,600	1,256.64	6,363,147,496	1,557.00	7,884,025,200	2.34
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	597,300	12,827.67	7,661,968,992	12,985.00	7,755,940,500	2.30

日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	178,700	24,168.76	4,318,956,816	39,570.00	7,071,159,000	2.10
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,716,100	2,294.28	3,937,215,736	3,487.00	5,984,040,700	1.78
日本	株式	キーエンス	電気機器	84,500	63,437.44	5,360,463,400	69,540.00	5,876,130,000	1.74
日本	株式	日立製作所	電気機器	409,700	10,306.68	4,222,648,188	13,905.00	5,696,878,500	1.69
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	591,200	7,263.86	4,294,395,957	8,909.00	5,267,000,800	1.56
日本	株式	信越化学工業	化学	758,300	5,223.35	3,960,863,287	6,584.00	4,992,647,200	1.48
日本	株式	三井物産	卸売業	670,800	5,403.26	3,624,505,435	7,106.00	4,766,704,800	1.42
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	25,179,100	173.22	4,361,410,696	179.80	4,527,202,180	1.34
日本	株式	任天堂	その他製品	533,100	6,930.82	3,694,822,137	8,196.00	4,369,287,600	1.30
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	643,100	5,517.89	3,548,556,850	6,707.00	4,313,271,700	1.28
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	600,100	5,748.63	3,449,753,792	6,466.00	3,880,246,600	1.15
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	821,400	3,657.48	3,004,255,304	4,703.00	3,863,044,200	1.15
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	2,007,100	1,511.50	3,033,725,690	1,891.00	3,795,426,100	1.13
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	417,900	6,057.62	2,531,478,955	8,962.00	3,745,219,800	1.11
日本	株式	第一三共	医薬品	738,300	4,009.37	2,960,114,604	4,777.00	3,526,859,100	1.05
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,122,200	2,514.52	2,821,790,412	3,046.00	3,418,221,200	1.01
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	751,300	4,165.44	3,129,496,000	4,184.00	3,143,439,200	0.93
日本	株式	HOYA	精密機器	166,200	16,694.02	2,774,545,883	18,740.00	3,114,588,000	0.92
日本	株式	KDDI	情報・通信業	654,100	4,622.04	3,023,278,800	4,482.00	2,931,676,200	0.87
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,361,800	1,800.17	2,451,474,799	1,951.00	2,656,871,800	0.79
日本	株式	三菱電機	電気機器	949,000	2,013.52	1,910,835,092	2,512.00	2,383,888,000	0.71
日本	株式	ディスコ	機械	41,000	32,237.27	1,321,728,160	57,190.00	2,344,790,000	0.70
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	459,700	5,032.06	2,313,238,164	4,849.00	2,229,085,300	0.66
日本	株式	村田製作所	電気機器	767,800	2,886.28	2,216,083,647	2,824.00	2,168,267,200	0.64
日本	株式	S M C	機械	25,500	74,635.07	1,903,194,168	84,830.00	2,163,165,000	0.64
日本	株式	三菱重工業	機械	1,491,000	830.14	1,237,743,135	1,448.50	2,159,713,500	0.64
日本	株式	ダイキン工業	機械	101,800	22,154.70	2,255,348,744	20,600.00	2,097,080,000	0.62

□ 種類別・業種別投資比率

2024年3月29日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式（国内）	水産・農林業	0.08
	鉱業	0.33
	建設業	2.05
	食料品	3.02
	繊維製品	0.36

パルプ・紙	0.16
化学	5.61
医薬品	4.18
石油・石炭製品	0.51
ゴム製品	0.68
ガラス・土石製品	0.68
鉄鋼	0.92
非鉄金属	0.70
金属製品	0.51
機械	5.51
電気機器	17.07
輸送用機器	9.32
精密機器	2.17
その他製品	2.24
電気・ガス業	1.36
陸運業	2.45
海運業	0.69
空運業	0.40
倉庫・運輸関連業	0.13
情報・通信業	7.12
卸売業	7.28
小売業	4.15
銀行業	7.27
証券、商品先物取引業	0.91
保険業	2.67
その他金融業	1.17
不動産業	2.10
サービス業	4.40
合計	98.20

## 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）

2024年3月29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	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	564,526	57,543.10	32,484,573,679	63,701.22	35,960,992,211	4.77
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	1,174,480	28,637.11	33,633,711,761	25,963.79	30,493,948,320	4.05

アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	197,544	74,425.41	14,702,294,068	136,808.02	27,025,603,423	3.59
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	743,977	22,317.52	16,603,722,211	27,311.34	20,319,005,674	2.70
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	177,648	51,174.17	9,090,988,425	73,521.67	13,060,977,241	1.73
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	473,896	20,480.41	9,705,582,114	22,852.31	10,829,618,915	1.44
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	412,461	20,690.21	8,533,905,444	23,053.69	9,508,746,628	1.26
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	64,661	90,645.22	5,861,210,332	117,790.92	7,616,478,910	1.01
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	35,646	144,659.25	5,156,523,514	200,680.33	7,153,450,975	0.95
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	231,777	23,548.14	5,457,918,124	30,327.42	7,029,199,120	0.93
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	105,086	54,623.73	5,740,189,199	63,670.93	6,690,923,686	0.89
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	228,609	36,632.03	8,374,410,695	26,616.36	6,084,740,334	0.81
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	319,361	15,494.77	4,948,423,878	17,599.90	5,620,721,152	0.75
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	74,182	80,849.41	5,997,571,220	74,902.53	5,556,419,257	0.74
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	126,723	38,598.40	4,891,305,247	42,255.50	5,354,744,081	0.71

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	259,962	15,195.29	3,950,197,822	19,282.84	5,012,806,691	0.67
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	66,608	62,261.31	4,147,101,219	72,914.51	4,856,689,928	0.64
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	32,361	104,223.11	3,372,764,201	145,642.73	4,713,144,320	0.63
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	189,216	22,929.66	4,338,659,102	24,566.27	4,648,331,817	0.62
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	193,233	23,101.23	4,463,919,971	23,951.55	4,628,229,455	0.61
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	79,203	47,374.86	3,752,230,826	58,080.88	4,600,179,621	0.61
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	203,578	15,521.42	3,159,819,357	19,978.55	4,067,193,150	0.54
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	35,569	90,205.52	3,208,520,049	110,927.51	3,945,580,542	0.52
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	141,866	21,274.12	3,018,074,993	27,571.76	3,911,495,446	0.52

アメリカ	株式	ADVANCED MICRO DEVICES	半導体・半導体製造装置	129,086	19,102.86	2,465,911,791	27,327.99	3,527,661,033	0.47
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	77,348	35,274.54	2,728,414,889	45,601.66	3,527,197,491	0.47
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	214,178	16,630.03	3,561,786,964	16,078.34	3,443,626,704	0.46
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	143,891	21,834.36	3,141,767,571	23,883.41	3,436,608,237	0.46
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	567,727	4,611.27	2,617,940,102	5,741.47	3,259,585,949	0.43
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	35,164	72,653.09	2,554,773,234	91,955.84	3,233,534,992	0.43

□ 種類別・業種別投資比率

2024年3月29日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式(外国)	エネルギー	4.60
	素材	3.77
	資本財	7.01
	商業・専門サービス	1.57
	運輸	1.67
	自動車・自動車部品	1.60
	耐久消費財・アパレル	1.48
	消費者サービス	1.99
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.86
	生活必需品流通・小売り	1.69
	食品・飲料・タバコ	3.21
	家庭用品・パーソナル用品	1.57
	ヘルスケア機器・サービス	4.21
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.82
	銀行	5.44
	金融サービス	6.65
	保険	3.06
	ソフトウェア・サービス	9.96
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.50
	半導体・半導体製造装置	8.24
電気通信サービス	1.08	
公益事業	2.45	
メディア・娯楽	6.24	
不動産管理・開発	0.30	



投資証券	-	1.94
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)

2024年3月29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	933,000	2,755.03	2,570,445,504	3,635.45	3,391,872,517	7.64
アメリカ	投資証 券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	-	262,425	6,031.25	1,582,749,857	6,686.27	1,754,643,250	3.95
香港	投資信 託受益 証券	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	-	2,316,000	746.2748	1,728,372,509	754.4300	1,747,259,884	3.93
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	180,755	8,186.66	1,479,780,325	9,090.00	1,643,062,950	3.70
ケイマ ン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディ ア・娯楽	250,800	6,080.03	1,524,872,339	5,875.49	1,473,573,393	3.32
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	617,500	1,406.68	868,626,558	1,358.64	838,957,112	1.89
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネル ギー	115,230	4,464.90	514,490,678	5,438.21	626,645,053	1.41
アメリカ	投資証 券	ISHARES MSCI UAE ETF	-	229,677	2,235.38	513,414,756	2,239.35	514,328,085	1.16
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・ 半導体製 造装置	20,778	14,907.81	309,754,382	20,047.50	416,546,955	0.94
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	22,721	21,262.38	483,102,615	17,601.41	399,921,693	0.90
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	196,480	1,734.09	340,713,885	2,000.74	393,105,198	0.89
ケイマ ン諸島	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者 サービス	193,460	1,732.31	335,132,978	1,872.11	362,178,787	0.82
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	476,800	482.72	230,162,875	735.13	350,508,196	0.79
アメリカ	投資証 券	ISHARES MSCI QATAR ETF	-	130,666	2,626.20	343,155,525	2,670.87	348,992,213	0.79

インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	125,669	2,701.29	339,468,840	2,741.43	344,512,955	0.78
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI KUWAIT ETF	-	66,766	4,573.60	305,361,027	5,087.98	339,704,181	0.76
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	3,661,000	87.30	319,598,849	91.28	334,193,652	0.75
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	58,000	4,561.31	264,556,100	5,483.90	318,066,200	0.72
インド	株式	HDFC BANK LIMITED	銀行	106,323	2,833.90	301,309,059	2,649.66	281,719,481	0.63
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	34,234	6,510.38	222,876,367	7,093.63	242,843,295	0.55
ブラジル	株式	VALE SA	素材	129,788	2,200.38	285,582,585	1,834.91	238,148,849	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	31,435	6,563.30	206,317,451	7,560.00	237,648,600	0.54
ケイマン諸島	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	73,800	3,419.36	252,348,916	3,148.55	232,363,137	0.52
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	2,120,400	86.23	182,851,660	96.72	205,085,088	0.46
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	180,200	1,073.67	193,475,451	1,126.95	203,075,618	0.46
インド	株式	BHARTI AIRTEL LTD	電気通信サービス	86,133	1,843.89	158,819,798	2,248.34	193,656,096	0.44
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	銀行	183,400	945.76	173,452,303	1,044.90	191,634,344	0.43
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	3,041,000	55.32	168,223,122	62.47	189,965,796	0.43
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	2,490,000	72.47	180,449,289	76.20	189,737,004	0.43
南アメリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	一般消費財・サービス流通・小売り	7,012	27,280.27	191,289,248	26,826.82	188,109,693	0.42

□ 種類別・業種別投資比率

2024年3月29日現在

種類	業種	投資比率 (%)
株式（外国）	エネルギー	4.42
	素材	5.27
	資本財	4.05
	商業・専門サービス	0.03

運輸		1.68
自動車・自動車部品		3.44
耐久消費財・アパレル		1.02
消費者サービス		2.26
一般消費財・サービス流通・小売り		4.48
生活必需品流通・小売り		1.28
食品・飲料・タバコ		2.16
家庭用品・パーソナル用品		0.72
ヘルスケア機器・サービス		0.70
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		2.06
銀行		12.03
金融サービス		2.16
保険		2.16
ソフトウェア・サービス		2.11
テクノロジー・ハードウェアおよび機器		8.36
半導体・半導体製造装置		10.64
電気通信サービス		1.90
公益事業		2.16
メディア・娯楽		5.35
不動産管理・開発		0.91
投資信託受益証券	-	3.93
投資証券	-	7.55
合計		92.85

## 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）

2024年3月29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	1,708	586,237.89	1,001,294,322	598,000.00	1,021,384,000	6.70
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,504	541,969.05	815,121,454	538,000.00	809,152,000	5.31
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	4,736	151,789.17	718,873,514	150,300.00	711,820,800	4.67
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	2,550	256,803.78	654,849,627	269,000.00	685,950,000	4.50
日本	投資証券	KDX不動産投資法人	4,212	149,989.99	631,757,820	158,700.00	668,444,400	4.39
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	7,022	91,758.25	644,326,452	94,700.00	664,983,400	4.37
日本	投資証券	GLP投資法人	4,918	121,502.95	597,551,506	125,600.00	617,700,800	4.05
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	2,208	247,147.53	545,701,747	258,800.00	571,430,400	3.75

日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	3,278	143,196.52	469,398,178	153,200.00	502,189,600	3.30
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	7,096	63,627.19	451,498,529	68,000.00	482,528,000	3.17
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	2,920	162,287.98	473,880,912	164,400.00	480,048,000	3.15
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	1,436	311,311.91	447,043,905	334,000.00	479,624,000	3.15
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	4,908	74,258.08	364,458,681	79,700.00	391,167,600	2.57
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	2,670	125,654.92	335,498,634	135,600.00	362,052,000	2.38
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	4,405	74,330.65	327,426,522	80,500.00	354,602,500	2.33
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	1,001	331,109.39	331,440,497	332,000.00	332,332,000	2.18
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	505	591,224.15	298,568,197	645,000.00	325,725,000	2.14
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	768	390,920.70	300,227,097	408,500.00	313,728,000	2.06
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	1,874	145,615.91	272,884,222	154,100.00	288,783,400	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	608	431,407.08	262,295,506	451,000.00	274,208,000	1.80
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	936	259,446.07	242,841,523	274,100.00	256,557,600	1.68
日本	投資証券	イオンリート投資法人	1,800	133,183.79	239,730,828	139,300.00	250,740,000	1.65
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	543	423,762.12	230,102,831	454,500.00	246,793,500	1.62
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	1,726	130,871.10	225,883,525	136,900.00	236,289,400	1.55
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	720	291,473.23	209,860,722	325,500.00	234,360,000	1.54
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	2,133	102,680.74	219,018,025	105,400.00	224,818,200	1.48
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	1,372	150,549.89	206,554,445	153,900.00	211,150,800	1.39
日本	投資証券	森トラストリート投資法人	2,831	71,620.48	202,757,568	72,200.00	204,398,200	1.34
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	505	355,658.27	179,607,426	383,000.00	193,415,000	1.27
日本	投資証券	N T T 都市開発リート投資法人	1,489	120,252.02	179,055,258	122,700.00	182,700,300	1.20

## □ 種類別投資比率

2024年3月29日現在

種類	投資比率（％）
投資証券	98.67
合計	98.67

## 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）

2024年3月29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	157,181	20,152.83	3,167,642,246	19,716.61	3,099,076,507	8.64
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	15,989	133,461.76	2,133,920,055	124,963.22	1,998,036,849	5.57
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	94,442	14,135.24	1,334,960,241	14,147.75	1,336,141,843	3.73
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	55,624	22,766.24	1,266,349,485	23,694.15	1,317,963,449	3.68
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	26,826	43,096.10	1,156,095,983	43,917.98	1,178,143,854	3.29
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	141,961	8,013.37	1,137,585,565	8,191.28	1,162,842,442	3.24
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	51,541	20,882.60	1,076,310,173	21,809.10	1,124,062,637	3.14
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	294,590	2,838.66	836,240,366	3,334.00	982,164,267	2.74
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	35,863	21,203.92	760,436,215	22,257.27	798,212,474	2.23
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	176,264	4,546.30	801,348,811	4,510.50	795,039,459	2.22
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	24,324	26,612.13	647,313,552	28,095.64	683,398,337	1.91
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	48,990	11,374.56	557,239,552	12,144.60	594,963,762	1.66
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	59,312	9,133.42	541,721,190	9,555.49	566,754,932	1.58
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	98,945	5,050.42	499,714,278	5,391.71	533,482,755	1.49
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	26,729	18,474.02	493,791,979	19,518.26	521,703,654	1.46
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	69,357	6,673.38	462,845,398	6,592.39	457,228,490	1.28
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,087	34,803.76	385,869,252	37,066.68	410,958,304	1.15
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	20,902	19,893.76	415,819,369	19,468.30	406,926,360	1.14
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	231,203	1,655.19	382,685,866	1,728.25	399,575,742	1.11

アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	19,910	19,146.09	381,198,600	19,922.53	396,657,528	1.11
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	118,744	3,069.08	364,434,918	3,131.16	371,806,320	1.04
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	118,217	2,518.58	297,739,334	2,838.94	335,610,674	0.94
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	112,087	2,958.55	331,615,150	2,969.15	332,803,127	0.93
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	46,310	6,877.54	318,498,708	6,975.46	323,033,492	0.90
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	36,813	8,475.93	312,024,477	8,545.58	314,588,451	0.88
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	31,447	10,117.22	318,156,097	9,750.80	306,633,533	0.86
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	901,932	306.28	276,243,362	334.29	301,504,954	0.84
アメリカ	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	53,816	5,335.69	287,145,406	5,568.86	299,693,758	0.84
アメリカ	投資証券	UDR INC	51,176	5,428.05	277,785,810	5,664.25	289,873,560	0.81
香港	投資証券	LINK REIT	436,700	743.16	324,537,098	650.79	284,200,429	0.79

## □ 種類別投資比率

2024年3月29日現在

種類	投資比率（％）
投資証券	97.45
合計	97.45

### 投資不動産物件

#### 国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

#### ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

#### 外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

#### 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

該当事項はありません。

#### 外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

#### エマージング株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

## Jリート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

## 外国リート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2024年3月29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	オフショア・人民元	買建	2,730,000.00	56,908,725	56,823,858	0.27
	ポーランド・ズロチ	買建	44,000.00	1,669,722	1,666,966	0.01
	アメリカ・ドル	売建	66,460,000.00	10,001,909,754	9,999,936,882	46.67
	ユーロ	売建	42,340,000.00	6,893,219,673	6,879,870,229	32.11
	オフショア・人民元	売建	92,390,000.00	1,917,617,921	1,914,413,190	8.93
	イギリス・ポンド	売建	5,873,000.00	1,117,124,878	1,116,258,506	5.21
	カナダ・ドル	売建	3,880,000.00	431,705,887	431,323,692	2.01
	オーストラリア・ドル	売建	2,958,000.00	290,754,617	290,215,522	1.35
	メキシコ・ペソ	売建	21,740,000.00	195,256,169	195,638,475	0.91
	シンガポール・ドル	売建	1,750,371.49	195,522,397	195,408,419	0.91
	ポーランド・ズロチ	売建	3,120,000.00	117,634,105	117,424,320	0.55
	イスラエル・シケル	売建	1,712,098.97	70,403,981	70,155,417	0.33
	デンマーク・クローネ	売建	2,615,514.57	57,091,859	56,994,325	0.27
	ニュージーランド・ドル	売建	580,000.00	52,220,416	52,149,192	0.24
	スウェーデン・クローナ	売建	3,090,000.00	43,564,444	43,534,198	0.20
ノルウェー・クローネ	売建	2,720,000.00	37,765,003	37,729,952	0.18	

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

2024年3月29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	オフショア・人民元	買建	37,820,000.00	788,383,691	787,208,172	0.43
	アメリカ・ドル	買建	3,525,000.00	533,360,795	533,296,192	0.29
	カナダ・ドル	買建	560,000.00	62,613,826	62,568,128	0.03
	ポーランド・ズロチ	買建	550,000.00	20,871,531	20,837,080	0.01
	ユーロ	売建	2,800,000.00	457,658,126	456,800,680	0.25
	イギリス・ポンド	売建	520,000.00	99,415,028	99,356,400	0.05
	メキシコ・ペソ	売建	7,320,000.00	66,627,057	66,622,980	0.04
	ノルウェー・クローネ	売建	780,000.00	10,881,287	10,865,868	0.01
	シンガポール・ドル	売建	48,380.19	5,424,696	5,421,029	0.00
	オーストラリア・ドル	売建	26,071.00	2,574,133	2,569,190	0.00
	イスラエル・シケル	売建	16,284.25	672,574	670,157	0.00

ニュージーランド・ドル	売建	2,493.34	225,710	225,460	0.00
-------------	----	----------	---------	---------	------

(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)

2024年3月29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0606 月2024年6月	買建	216	日本・円	5,911,011,700	5,983,200,000	1.78

(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

2024年3月29日現在

種類	国/地域	取引所等	名称	買建/売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価(円)	評価額	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	イギリス	ICE EUEX	FTSE 100 INDEX FUTURE JUN 24 2024年6月	買建	42	イギリス・ポンド	3,286,929.00	628,526,563	3,354,960.00	641,535,451	0.09
	ドイツ	EUROSTOX	EURO STOXX 50 INDEX JUN 24 2024年6月	買建	275	ユーロ	13,661,320.00	2,230,073,876	13,873,750.00	2,264,750,950	0.30
	アメリカ	シカゴ商品取引所	S&P 500 EMIN INDEX FUTURE JUN 24 2024年6月	買建	309	アメリカ・ドル	81,098,337.00	12,279,099,205	82,016,325.00	12,418,091,768	1.65
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200 INDEX FUTURE RES JUN 24 2024年6月	買建	24	オーストラリア・ドル	4,653,183.00	458,850,375	4,770,600.00	470,428,866	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。

2024年3月29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	15,731,000.00	2,381,626,726	2,380,438,198	0.32
	ユーロ	買建	1,129,000.00	185,001,069	184,210,462	0.02
	イギリス・ポンド	買建	799,000.00	152,731,873	152,688,900	0.02
	カナダ・ドル	買建	577,000.00	64,291,186	64,476,865	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

2024年3月29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 J U N 2 4 2024年6月	買建	406	アメ リカ・ド ル	21,409,956.00	3,241,681,437	21,294,700.00	3,224,230,527	7.26

(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。

2024年3月29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	636,121.03	96,284,882	96,254,061	0.22
	ブラジル・レアル	売建	11,158.12	338,819	336,579	0.00
	フィリピン・ペソ	売建	54,274.50	146,063	145,862	0.00

(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

2024年3月29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 6 0 6 月 2 0 2 4 年 6 月	買建	20	日本・円	33,824,400	35,720,000	0.23

(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

2024年3月29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	418,746.29	63,400,000	63,362,092	0.18
	オーストラリア・ドル	買建	67,812.39	6,700,000	6,683,507	0.02
	イギリス・ポンド	買建	32,434.17	6,200,000	6,198,169	0.02

(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。

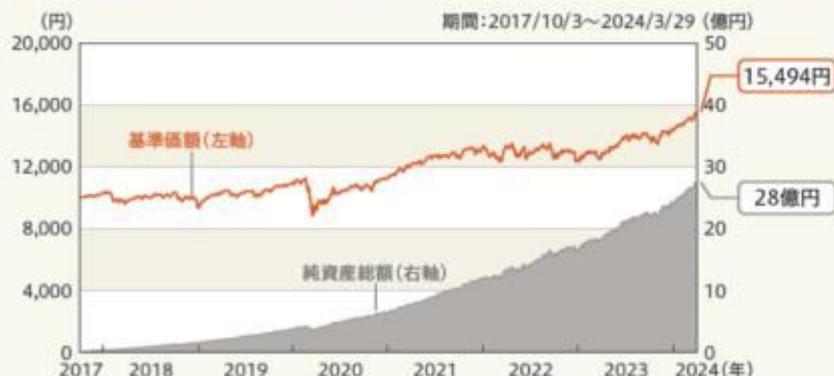
## 参考情報

基準日: 2024年3月29日

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

※委託会社ホームページにおいてもファンドの運用状況は適宜開示しています。

## 基準価額・純資産の推移



## 分配の推移

決算期	分配金
2023年9月	0円
2022年9月	0円
2021年9月	0円
2020年9月	0円
2019年9月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。  
※直近5計算期間を記載しています。

## 主要な資産の状況

■三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

## 資産別構成

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

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	20.08
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	19.70
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	14.98
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	14.68
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)	9.99
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	9.88
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	5.00
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	4.71

※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)」は相入有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

### ■国内債券パッシブ・マザーファンド

#### 主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	国債証券	150 5年国債	0.005	2026/12/20	2.33
日本	国債証券	165 5年国債	0.300	2028/12/20	1.13
日本	国債証券	147 5年国債	0.005	2026/03/20	0.98
日本	国債証券	149 5年国債	0.005	2026/09/20	0.96
日本	国債証券	156 5年国債	0.200	2027/12/20	0.95

### ■ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

#### 主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.000	2027/01/15	0.83
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.500	2033/02/15	0.68
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2030/03/31	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.125	2053/08/15	0.63
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.300	2026/05/15	0.63

### ■外国債券パッシブ・マザーファンド

#### 主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2026/05/15	0.88
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2026/03/31	0.64
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.390	2026/11/15	0.63
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.690	2026/08/12	0.57
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	3.720	2051/04/12	0.53

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

## ■国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

## 主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	5.22
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.34
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2.30
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	2.10
日本	株式	三菱商事	卸売業	1.78

## ■外国株式インデックス・マザーファンド

## 主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4.77
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	4.05
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	3.59
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	2.70
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	1.73

## ■エマージング株式インデックス・マザーファンド

## 主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	7.64
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	—	3.95
香港	投資信託受益証券	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	—	3.93
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	3.70
ケイマン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	3.32

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

## ■Jリート・インデックス・マザーファンド

### 主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	6.70
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	5.31
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	4.67
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	4.50
日本	投資証券	KDX不動産投資法人	4.39

## ■外国リート・インデックス・マザーファンド

### 主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	8.64
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	5.57
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	3.73
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	3.68
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	3.29

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



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

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

※2024年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込(販売)手続等】

#### イ 申込方法

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

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

(ロ) 原則として午後3時\*までに、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、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、お申込みの販売会社にご確認ください。

\*2024年11月5日以降は、午後3時30分までに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する予定です。

また、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。

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

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

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

(二) 申込不可日

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

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

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

ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

ハ 申込手数料

ありません。

ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社にお問い合わせください。

ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

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

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

## 2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

ただし、以下のいずれかに当たる場合には、解約請求の受付は行いません。

- ・ニューヨークの取引所の休業日
- ・ロンドンの取引所の休業日

- ・ニューヨークの銀行の休業日
- ・ロンドンの銀行の休業日

解約請求のお申込みに関しては、原則として午後3時\*までに、解約請求のお申込みが行われ販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の解約請求受付分とします。なお、販売会社によっては対応が異なる場合がありますので、お申込みの販売会社にご確認ください。

\*2024年11月5日以降は、午後3時30分までに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する予定です。

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して6営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### イ 基準価額の算出方法

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

<主要投資対象の評価方法>

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

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

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

(2) 【保管】

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

(3) 【信託期間】

2017年10月3日から下記「(5) その他 イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

(4) 【計算期間】

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

(5) 【その他】

イ 信託の終了

(イ) 信託契約の解約

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



当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b～dまでの取扱いを行うことが困難な場合も同様とします。

(ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令

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

(ハ) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

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

(ニ) 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6期(2022年9月13日から2023年9月11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】

## 【三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 (2022年 9月12日現在)	第6期 (2023年 9月11日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	691,882	636,228
コール・ローン	19,446,501	26,933,570
親投資信託受益証券	1,618,812,630	2,194,933,022
未収入金	395,000	3,200,000
流動資産合計	1,639,346,013	2,225,702,820
資産合計	1,639,346,013	2,225,702,820
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	3,192,741	5,928,762
未払受託者報酬	158,101	224,291
未払委託者報酬	1,502,342	2,131,087
その他未払費用	47,438	67,424
流動負債合計	4,900,622	8,351,564
負債合計	4,900,622	8,351,564
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,214,217,954	1,577,588,079
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	420,227,437	639,763,177
（分配準備積立金）	202,112,152	292,408,266
元本等合計	1,634,445,391	2,217,351,256
純資産合計	1,634,445,391	2,217,351,256
負債純資産合計	1,639,346,013	2,225,702,820

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第5期		第6期	
	自	2021年 9月11日	自	2022年 9月13日
	至	2022年 9月12日	至	2023年 9月11日
<b>営業収益</b>				
受取利息		144		282
有価証券売買等損益		70,746,872		110,936,389
営業収益合計		70,747,016		110,936,671
<b>営業費用</b>				
支払利息		5,252		11,936
受託者報酬		282,953		408,823
委託者報酬		2,688,814		3,884,560
その他費用		85,293		123,306
営業費用合計		3,062,312		4,428,625
営業利益又は営業損失( )		67,684,704		106,508,046
経常利益又は経常損失( )		67,684,704		106,508,046
当期純利益又は当期純損失( )		67,684,704		106,508,046
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )		1,424,141		1,292,929
期首剰余金又は期首欠損金( )		226,170,241		420,227,437
剰余金増加額又は欠損金減少額		150,238,508		155,127,399
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		150,238,508		155,127,399
剰余金減少額又は欠損金増加額		22,441,875		43,392,634
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		22,441,875		43,392,634
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金( )		420,227,437		639,763,177

## （ 3 ）【注記表】

## （重要な会計方針の注記）

項 目	第6期	
	自 2022年9月13日 至 2023年9月11日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>計算期間の取扱い</p> <p>当計算期間は前期末および当期末が休日のため、2022年9月13日から2023年9月11日までとなっております。</p>	

## （重要な会計上の見積りに関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項 目	第5期	第6期
	（2022年9月12日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,214,217,954口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.3461円 （1万口当たりの純資産額13,461円）	1口当たり純資産額 1.4055円 （1万口当たりの純資産額14,055円）

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

項 目	第5期	第6期
	自 2021年9月11日 至 2022年9月12日	
	自 2022年9月13日 至 2023年9月11日	

分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(26,121,836円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(40,138,727円)、収益調整金(218,115,285円)、および分配準備積立金(135,851,589円)より、分配対象収益は420,227,437円(1万口当たり3,460.89円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(42,217,881円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(65,583,094円)、収益調整金(347,354,911円)、および分配準備積立金(184,607,291円)より、分配対象収益は639,763,177円(1万口当たり4,055.32円)であります。分配を行っておりません。
----------	---	---

## (金融商品に関する注記)

## ・金融商品の状況に関する事項

項目	第6期 自 2022年9月13日 至 2023年9月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>



<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6期 (2023年9月11日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
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5期（自 2021年9月11日 至 2022年9月12日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	66,805,775円
合計	66,805,775円

## 第6期（自 2022年9月13日 至 2023年9月11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	108,448,053円
合計	108,448,053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6期 自 2022年9月13日 至 2023年9月11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5期 (2022年9月12日現在)	第6期 (2023年9月11日現在)
期首元本額	788,236,116円	1,214,217,954円
期中追加設定元本額	503,710,231円	492,057,391円
期中一部解約元本額	77,728,393円	128,687,266円

## （４）【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド（B号）	54,438,122	224,089,085	
	外国株式インデックス・マザーファンド	60,936,519	444,537,999	
	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	85,609,309	104,032,432	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	208,489,850	439,621,697	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	269,611,226	326,849,689	
	Jリート・インデックス・マザーファンド	39,990,515	107,194,575	
	外国リート・インデックス・マザーファンド	111,536,949	330,439,365	

エマージング株式インデックス・マ ザーファンド	120,116,820	218,168,180	
親投資信託受益証券 小計		2,194,933,022	
合 計		2,194,933,022	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2022年9月12日現在)	(2023年9月11日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	15,404,179	10,210,097
コール・ローン	432,960,001	432,225,963
国債証券	104,003,852,680	101,717,238,760
地方債証券	10,290,112,600	9,945,071,700
特殊債券	9,372,625,977	9,472,283,708
社債券	6,035,333,600	6,161,963,800
未収入金	59,880,900	-
未収利息	361,877,661	345,064,327
前払費用	16,416,621	22,954,890
流動資産合計	130,588,464,219	128,107,013,245
資産合計	130,588,464,219	128,107,013,245
負債の部		
流動負債		
未払金	-	94,901,000
未払解約金	72,957,000	160,000
その他未払費用	2,171	5,714
流動負債合計	72,959,171	95,066,714
負債合計	72,959,171	95,066,714
純資産の部		
元本等		
元本	105,070,373,916	105,595,755,237
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	25,445,131,132	22,416,191,294

元本等合計	130,515,505,048	128,011,946,531
純資産合計	130,515,505,048	128,011,946,531
負債純資産合計	130,588,464,219	128,107,013,245

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年9月13日 至 2023年9月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年9月12日現在)	(2023年9月11日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	105,070,373,916口	105,595,755,237口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2422円 (1万口当たりの純資産額12,422円)	1口当たり純資産額 1.2123円 (1万口当たりの純資産額12,123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9月13日 至 2023年9月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券</p> <p>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年9月11日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>

	(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。

## (関連当事者との取引に関する注記)

自 2022年9月13日
至 2023年9月11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9月12日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	106,912,762,885円
同期中における追加設定元本額	24,077,751,218円
同期中における一部解約元本額	25,920,140,187円
2022年9月12日現在の元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	7,405,294,843円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	12,270,168,802円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,846,992,295円
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)	823,848,056円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	41,070,800円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	188,185,362円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	504,029,049円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	879,417,622円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	450,102,528円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	581,272,184円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	140,807,106円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,924,964,674円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,056,053,003円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	422,825,277円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	57,571,397円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,949,732,234円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	654,426,007円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	970,730,653円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	217,690,587円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	35,698,724円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	192,969,140円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	283,890,678円

三井住友D S・年金バランス50(標準型)	506,037,343円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	144,781,815円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	8,007,380円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,217,386,473円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	11,436,365,442円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	6,128,242,930円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	15,401,942,052円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	306,310,460円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	526,289,799円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	257,205,778円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	119,981,072円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,802,337,039円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,124,463,694円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,254,065,737円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	8,157,611,864円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	961,967円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,109,862,458円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	415,038,581円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	499,895,584円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	170,458,356円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	43,709,085円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,352,499,366円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,036,009,210円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	649,577,213円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	210,001,663円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	20,814,251円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	265,467,132円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	4,985,334,340円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	1,213,665,167円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	1,185,737,715円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	1,518,563,091円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド <適格機関投資家限定>	5,104,008,838円
合計	105,070,373,916円

(2023年9月11日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	105,070,373,916円
同期中における追加設定元本額	29,627,474,001円
同期中における一部解約元本額	29,102,092,680円
2023年9月11日現在の元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	8,895,871,906円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	14,276,531,560円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,639,693,680円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	871,073,171円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	41,964,940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)	189,022,302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)	597,899,046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)	1,152,268,985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)	635,710,120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)	765,396,816円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	145,241,149円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	943,791,009円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	331,990,644円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	13,054,188円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	86,411,203円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	4,478,509,550円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,439,958,484円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	2,358,439,215円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	554,742,232円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	53,974,627円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	269,611,226円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	370,316,428円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	769,947,923円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	239,821,733円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	11,065,309円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	395,316円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	340,706円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	234,563円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	113,477円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	115,120円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	2,360,942円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	12,350,202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)	31,875,293円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	7,622,799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)	992,596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>	1,091,741,014円
S M A M・バランスファンドV A 2 5<適格機関投資家専用>	9,468,188,150円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用>	5,717,595,087円
S M A M・バランスファンドV A 5 0<適格機関投資家専用>	14,505,099,336円
S M A M・バランスファンドV L 3 0<適格機関投資家限定>	299,776,143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>	486,840,988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>	264,798,022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>	116,608,704円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5<適格機関投資家専用>	1,721,293,475円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0<適格機関投資家専用>	2,097,868,199円
S M A M・バランスファンドV A 4 0<適格機関投資家専用>	2,141,404,899円
S M A M・バランスファンドV A 3 5<適格機関投資家専用>	7,504,519,879円
S M A M・バランスV A 株4 0 T<適格機関投資家限定>	1,001,996円
三井住友・国内債券インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	997,923,867円
S M A M・グローバルバランス4 0 V A<適格機関投資家限定>	378,194,192円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A<適格機関投資家専用>	466,557,662円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A<適格機関投資家専用>	171,339,049円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A<適格機関投資家専用>	47,446,788円



SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,194,682,155円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	1,995,130,514円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	588,317,252円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	208,632,864円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	21,745,950円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	253,927,864円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	4,607,178,796円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	1,270,648,412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>	801,786,380円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	1,280,562,535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>	2,417,659,545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>	288,577,060円
合 計	105,595,755,237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	450 2年国債	160,000,000	159,942,400	
	451 2年国債	4,520,000,000	4,518,282,400	
	452 2年国債	180,000,000	179,875,800	
	144 5年国債	890,000,000	891,335,000	
	145 5年国債	1,180,000,000	1,181,663,800	
	146 5年国債	1,000,000,000	1,001,130,000	
	147 5年国債	1,310,000,000	1,308,021,900	
	148 5年国債	1,130,000,000	1,127,491,400	
	149 5年国債	1,240,000,000	1,236,441,200	
	150 5年国債	1,130,000,000	1,125,762,500	
	151 5年国債	230,000,000	228,912,100	
	152 5年国債	340,000,000	339,520,600	
	153 5年国債	1,080,000,000	1,073,520,000	
	154 5年国債	1,060,000,000	1,056,184,000	
	156 5年国債	880,000,000	879,436,800	
	157 5年国債	570,000,000	568,848,600	
	158 5年国債	930,000,000	923,973,600	
	159 5年国債	100,000,000	99,199,000	
	160 5年国債	1,190,000,000	1,185,513,700	
	1 40年国債	40,000,000	46,958,000	
2 40年国債	242,000,000	274,019,020		
3 40年国債	185,000,000	209,170,250		

4	40年国債	247,000,000	279,045,780	
5	40年国債	235,000,000	255,155,950	
6	40年国債	240,000,000	255,201,600	
7	40年国債	265,000,000	269,054,500	
8	40年国債	290,000,000	272,704,400	
9	40年国債	503,000,000	345,445,310	
10	40年国債	440,000,000	354,618,000	
11	40年国債	400,000,000	309,564,000	
12	40年国債	360,000,000	247,345,200	
13	40年国債	515,000,000	349,386,300	
14	40年国債	475,000,000	344,113,750	
15	40年国債	520,000,000	413,608,000	
16	40年国債	250,000,000	217,370,000	
339	10年国債	350,000,000	352,383,500	
340	10年国債	770,000,000	775,751,900	
341	10年国債	557,000,000	560,158,190	
342	10年国債	350,000,000	350,304,500	
343	10年国債	310,000,000	310,127,100	
344	10年国債	811,000,000	811,000,000	
345	10年国債	258,000,000	257,829,720	
346	10年国債	340,000,000	339,520,600	
347	10年国債	100,000,000	99,756,000	
348	10年国債	145,000,000	144,478,000	
349	10年国債	550,000,000	547,321,500	
350	10年国債	510,000,000	506,695,200	
351	10年国債	350,000,000	347,196,500	
352	10年国債	350,000,000	346,706,500	
353	10年国債	680,000,000	672,588,000	
354	10年国債	705,000,000	696,208,650	
355	10年国債	930,000,000	916,849,800	
356	10年国債	800,000,000	787,272,000	
357	10年国債	960,000,000	942,950,400	
358	10年国債	990,000,000	970,200,000	
359	10年国債	1,060,000,000	1,036,298,400	
360	10年国債	1,150,000,000	1,121,457,000	
361	10年国債	1,200,000,000	1,166,724,000	
362	10年国債	1,150,000,000	1,114,649,000	
363	10年国債	910,000,000	879,478,600	
364	10年国債	1,120,000,000	1,079,612,800	
365	10年国債	1,040,000,000	999,804,000	
366	10年国債	610,000,000	589,748,000	
367	10年国債	1,250,000,000	1,205,825,000	
368	10年国債	610,000,000	586,856,600	
369	10年国債	1,110,000,000	1,094,959,500	
370	10年国債	1,280,000,000	1,259,955,200	

371	10年国債	990,000,000	962,398,800	
2	30年国債	440,000,000	495,721,600	
4	30年国債	340,000,000	398,007,400	
5	30年国債	290,000,000	326,363,100	
7	30年国債	474,000,000	541,630,320	
9	30年国債	240,000,000	256,185,600	
10	30年国債	95,000,000	98,743,000	
11	30年国債	430,000,000	470,824,200	
12	30年国債	570,000,000	646,243,200	
14	30年国債	392,000,000	456,832,880	
16	30年国債	205,000,000	241,643,750	
18	30年国債	190,000,000	220,287,900	
19	30年国債	170,000,000	197,217,000	
21	30年国債	345,000,000	400,810,650	
22	30年国債	315,000,000	373,590,000	
23	30年国債	349,000,000	414,140,850	
24	30年国債	310,000,000	368,239,700	
25	30年国債	290,000,000	337,330,900	
26	30年国債	253,000,000	297,659,560	
27	30年国債	250,000,000	297,395,000	
28	30年国債	96,000,000	114,327,360	
29	30年国債	157,000,000	184,740,330	
30	30年国債	142,000,000	165,023,880	
31	30年国債	235,000,000	269,293,550	
32	30年国債	360,000,000	417,466,800	
33	30年国債	168,000,000	186,864,720	
34	30年国債	87,000,000	99,305,280	
35	30年国債	260,000,000	288,256,800	
36	30年国債	90,000,000	99,550,800	
37	30年国債	225,000,000	244,653,750	
38	30年国債	220,000,000	234,748,800	
39	30年国債	220,000,000	238,323,800	
40	30年国債	260,000,000	276,913,000	
41	30年国債	240,000,000	251,169,600	
42	30年国債	280,000,000	292,686,800	
43	30年国債	255,000,000	266,452,050	
44	30年国債	310,000,000	323,528,400	
45	30年国債	315,000,000	317,044,350	
46	30年国債	315,000,000	316,801,800	
47	30年国債	250,000,000	255,780,000	
48	30年国債	400,000,000	394,028,000	
49	30年国債	345,000,000	339,521,400	
50	30年国債	325,000,000	282,425,000	
51	30年国債	305,000,000	235,097,050	
52	30年国債	273,000,000	220,068,030	

5 3	3 0 年国債	277,000,000	227,901,750	
5 4	3 0 年国債	105,000,000	90,183,450	
5 5	3 0 年国債	375,000,000	321,123,750	
5 6	3 0 年国債	320,000,000	273,206,400	
5 7	3 0 年国債	335,000,000	285,155,350	
5 8	3 0 年国債	420,000,000	356,437,200	
5 9	3 0 年国債	390,000,000	322,019,100	
6 0	3 0 年国債	240,000,000	207,386,400	
6 1	3 0 年国債	265,000,000	217,384,800	
6 2	3 0 年国債	235,000,000	182,376,450	
6 3	3 0 年国債	230,000,000	172,856,500	
6 4	3 0 年国債	315,000,000	235,802,700	
6 5	3 0 年国債	425,000,000	317,173,250	
6 6	3 0 年国債	310,000,000	230,237,000	
6 7	3 0 年国債	320,000,000	250,403,200	
6 8	3 0 年国債	360,000,000	280,695,600	
6 9	3 0 年国債	350,000,000	279,828,500	
7 0	3 0 年国債	350,000,000	279,149,500	
7 1	3 0 年国債	320,000,000	254,588,800	
7 2	3 0 年国債	340,000,000	270,082,400	
7 3	3 0 年国債	320,000,000	253,571,200	
7 4	3 0 年国債	320,000,000	274,601,600	
7 5	3 0 年国債	420,000,000	388,668,000	
7 6	3 0 年国債	370,000,000	350,811,800	
7 7	3 0 年国債	350,000,000	347,574,500	
7 8	3 0 年国債	420,000,000	397,576,200	
7 9	3 0 年国債	230,000,000	206,859,700	
7 8	2 0 年国債	590,000,000	609,676,500	
8 2	2 0 年国債	620,000,000	645,928,400	
8 4	2 0 年国債	500,000,000	522,115,000	
8 5	2 0 年国債	645,000,000	677,991,750	
8 8	2 0 年国債	742,000,000	787,410,400	
8 9	2 0 年国債	20,000,000	21,168,800	
9 0	2 0 年国債	580,000,000	616,690,800	
9 2	2 0 年国債	324,000,000	344,959,560	
9 3	2 0 年国債	632,000,000	673,263,280	
9 5	2 0 年国債	305,000,000	329,457,950	
9 7	2 0 年国債	327,000,000	353,303,880	
9 9	2 0 年国債	153,000,000	165,240,000	
1 0 0	2 0 年国債	207,000,000	225,182,880	
1 0 1	2 0 年国債	355,000,000	389,356,900	
1 0 2	2 0 年国債	457,000,000	503,074,740	
1 0 5	2 0 年国債	370,000,000	403,348,100	
1 0 6	2 0 年国債	370,000,000	405,179,600	
1 0 7	2 0 年国債	378,000,000	413,411,040	

109	20年国債	140,000,000	152,034,400	
111	20年国債	386,000,000	426,746,160	
113	20年国債	27,000,000	29,786,400	
114	20年国債	263,000,000	290,885,890	
116	20年国債	100,000,000	111,469,000	
118	20年国債	200,000,000	220,874,000	
119	20年国債	295,000,000	321,797,800	
120	20年国債	200,000,000	215,534,000	
121	20年国債	55,000,000	60,469,200	
122	20年国債	130,000,000	142,041,900	
123	20年国債	80,000,000	89,199,200	
124	20年国債	190,000,000	210,512,400	
125	20年国債	205,000,000	230,415,900	
126	20年国債	180,000,000	199,634,400	
127	20年国債	145,000,000	159,765,350	
128	20年国債	65,000,000	71,698,900	
130	20年国債	155,000,000	170,014,850	
131	20年国債	380,000,000	413,892,200	
132	20年国債	450,000,000	490,743,000	
133	20年国債	190,000,000	208,705,500	
134	20年国債	200,000,000	219,894,000	
135	20年国債	155,000,000	169,159,250	
136	20年国債	120,000,000	129,934,800	
137	20年国債	185,000,000	202,121,750	
139	20年国債	60,000,000	65,052,600	
140	20年国債	420,000,000	459,144,000	
141	20年国債	360,000,000	393,912,000	
142	20年国債	240,000,000	264,828,000	
143	20年国債	150,000,000	162,844,500	
144	20年国債	170,000,000	182,950,600	
145	20年国債	110,000,000	120,443,400	
146	20年国債	195,000,000	213,560,100	
147	20年国債	500,000,000	542,600,000	
148	20年国債	409,000,000	439,544,120	
149	20年国債	495,000,000	531,729,000	
150	20年国債	451,000,000	479,376,920	
151	20年国債	840,000,000	873,835,200	
152	20年国債	420,000,000	436,333,800	
153	20年国債	587,000,000	615,586,900	
154	20年国債	440,000,000	455,800,400	
155	20年国債	410,000,000	414,530,500	
156	20年国債	430,000,000	403,537,800	
157	20年国債	495,000,000	450,920,250	
158	20年国債	380,000,000	358,518,600	
159	20年国債	388,000,000	369,597,160	

	1 6 0	2 0 年国債	345,000,000	331,883,100	
	1 6 1	2 0 年国債	610,000,000	576,974,600	
	1 6 2	2 0 年国債	470,000,000	443,064,300	
	1 6 3	2 0 年国債	700,000,000	657,636,000	
	1 6 4	2 0 年国債	475,000,000	438,220,750	
	1 6 5	2 0 年国債	600,000,000	551,106,000	
	1 6 6	2 0 年国債	455,000,000	428,769,250	
	1 6 7	2 0 年国債	440,000,000	400,765,200	
	1 6 8	2 0 年国債	490,000,000	437,570,000	
	1 6 9	2 0 年国債	450,000,000	393,421,500	
	1 7 0	2 0 年国債	515,000,000	448,194,200	
	1 7 1	2 0 年国債	415,000,000	359,261,350	
	1 7 2	2 0 年国債	480,000,000	420,681,600	
	1 7 3	2 0 年国債	445,000,000	387,986,600	
	1 7 4	2 0 年国債	870,000,000	755,073,000	
	1 7 5	2 0 年国債	605,000,000	532,224,550	
	1 7 6	2 0 年国債	670,000,000	586,819,500	
	1 7 7	2 0 年国債	600,000,000	513,888,000	
	1 7 8	2 0 年国債	500,000,000	434,300,000	
	1 7 9	2 0 年国債	500,000,000	432,635,000	
	1 8 0	2 0 年国債	500,000,000	455,210,000	
	1 8 1	2 0 年国債	530,000,000	489,879,000	
	1 8 2	2 0 年国債	440,000,000	419,852,400	
	1 8 3	2 0 年国債	440,000,000	440,664,400	
	1 8 4	2 0 年国債	670,000,000	635,287,300	
	1 8 5	2 0 年国債	740,000,000	699,662,600	
		国債証券 小計		101,717,238,760	
地方債証券	1	東京都30年	100,000,000	112,933,700	
	8	東京都30年	400,000,000	453,413,600	
	13	東京都30年	500,000,000	540,479,500	
	6	東京都20年	100,000,000	102,873,300	
	26-15	北海道公債	100,000,000	100,470,600	
	30-18	北海道公債	200,000,000	196,630,600	
	208	神奈川県公債	200,000,000	200,785,800	
	210	神奈川県公債	100,000,000	100,472,100	
	211	神奈川県公債	100,000,000	100,462,000	
	1	神奈川県20年	100,000,000	101,945,500	
	3	神奈川県20年	100,000,000	103,492,500	
	7	神奈川県20年	100,000,000	106,869,600	
	13	神奈川県20年	100,000,000	110,395,400	
	388	大阪府公債	100,000,000	100,484,600	
	392	大阪府公債	100,000,000	100,356,100	
	1	大阪府20年	200,000,000	219,792,400	
	179	大阪府5年	100,000,000	99,544,900	
	193	大阪府5年	300,000,000	297,158,700	

27-4	京都府公債	100,000,000	100,736,400	
29-4	京都府公債	100,000,000	99,641,800	
1-6	京都府5年	200,000,000	199,879,400	
5	兵庫県公債15年	300,000,000	312,846,000	
10	兵庫県公債20年	100,000,000	110,618,900	
7	静岡県30年	100,000,000	108,655,100	
1	静岡県20年	100,000,000	104,100,400	
22-8	愛知県20年	200,000,000	217,613,000	
27-16	愛知県公債	400,000,000	402,533,600	
2	埼玉県公債	300,000,000	296,850,600	
5	埼玉県20年	100,000,000	108,866,900	
26-3	福岡県公債	100,000,000	100,487,200	
26-10	福岡県公債	100,000,000	100,510,700	
1-1	福岡県公債	200,000,000	194,920,200	
1-3	福岡県30年	100,000,000	74,164,900	
26-4	千葉県公債	100,000,000	100,514,500	
27-3	千葉県公債	100,000,000	100,686,500	
28-1	千葉県公債	100,000,000	99,678,900	
9	千葉県20年	200,000,000	216,951,000	
137	共同発行地方	200,000,000	200,974,800	
138	共同発行地方	200,000,000	201,029,000	
155	共同発行地方	100,000,000	100,088,000	
172	共同発行地方	500,000,000	498,697,000	
183	共同発行地方	600,000,000	594,901,800	
199	共同発行地方	100,000,000	97,258,200	
1-1	大阪市5年	300,000,000	299,970,000	
3	名古屋市20年	100,000,000	103,352,800	
5	名古屋市20年	100,000,000	106,267,100	
1	京都市30年	100,000,000	117,952,200	
7	京都市20年	100,000,000	109,801,300	
26-4	神戸市公債	200,000,000	200,959,000	
26-17	神戸市公債	100,000,000	100,257,200	
26-3	横浜市公債	200,000,000	200,974,800	
4	横浜市20年	100,000,000	102,912,600	
7	横浜市20年	100,000,000	104,267,100	
9	横浜市20年	100,000,000	105,913,900	
14	横浜市20年	100,000,000	108,738,500	
26-4	札幌市公債	100,000,000	100,382,800	
2-7	札幌市公債	100,000,000	96,324,200	
94	川崎市公債	100,000,000	95,293,200	
1-2	北九州市5年	100,000,000	99,939,300	
	地方債証券 小計		9,945,071,700	
特殊債券	47日本政策投資CO	100,000,000	103,064,000	
	36日本政策投資B	100,000,000	107,132,900	
	18道路機構	100,000,000	124,882,700	

2 2	道路機構	300,000,000	363,031,200	
2 7	道路機構	100,000,000	108,192,600	
3 7	道路機構	300,000,000	328,595,400	
4 7	道路機構	200,000,000	221,389,200	
7 9	政保道路機構	200,000,000	218,703,000	
8 1	政保道路機構	200,000,000	218,909,000	
8 8	政保道路機構	100,000,000	115,391,200	
9 0	政保道路機構	500,000,000	549,080,000	
9 9	政保道路機構	100,000,000	110,749,300	
1 7 6	政保道路機構	100,000,000	107,982,900	
1 9 6	政保道路機構	100,000,000	109,253,600	
2 1 0	政保道路機構	200,000,000	214,063,200	
2 2 7	政保道路機構	200,000,000	201,105,400	
2 3 1	政保道路機構	300,000,000	301,693,200	
2 8 8	政保道路機構	189,000,000	188,061,804	
9	道路債券	100,000,000	117,856,900	
2	地方公営 2 0 年	100,000,000	110,051,600	
F 9 6	地方公共団体	100,000,000	104,330,800	
F 1 4 3	地方公共団体	100,000,000	104,064,000	
6 1	地方公共団体	100,000,000	100,490,800	
6 2	地方公共団体	400,000,000	401,956,400	
6 3	地方公共団体	100,000,000	100,486,600	
6 4	地方公共団体	100,000,000	100,504,400	
6 7	政保地方公共団	100,000,000	100,533,500	
7 6	政保地方公共団	300,000,000	301,910,100	
8 5	地方公共団体	100,000,000	99,600,800	
1 0 1	地方公共団体	100,000,000	99,617,000	
1 0 6	地方公共団体	200,000,000	198,504,200	
2 9	地方公共団 5 年	300,000,000	298,096,500	
1 5	公営企業 2 0 年	100,000,000	104,019,900	
1 7	公営企業 2 0 年	100,000,000	105,510,200	
2 0	公営企業 2 0 年	100,000,000	106,940,500	
2 2	公営企業 2 0 年	100,000,000	107,553,300	
2 4	公営企業 2 0 年	200,000,000	217,380,200	
1 1 7	都市再生	100,000,000	101,148,400	
5 2	住宅支援機構	100,000,000	109,475,000	
9 3	住宅支援機構	100,000,000	104,248,100	
1 2 4	住宅支援機構	100,000,000	104,609,900	
1 3 0	住宅支援機構	200,000,000	216,609,200	
2 2 6	住宅支援機構	100,000,000	99,570,300	
S 3	住宅機構 R M B S	9,354,000	9,366,160	
S 5	住宅機構 R M B S	19,922,000	19,945,906	
S 7	住宅機構 R M B S	10,172,000	10,262,530	
S 9	住宅機構 R M B S	10,461,000	10,567,702	
S 1 0	住宅機構 R M B S	10,319,000	10,413,934	



S 1 1	住宅機構 R M B S	11,139,000	11,328,363	
3 5	住宅金融 R M B S	9,978,000	9,987,978	
4 1	住宅金融 R M B S	9,837,000	9,849,788	
5 3	住宅金融 R M B S	9,724,000	9,736,641	
2	住宅機構 R M B S	20,004,000	20,214,042	
1 9	住宅機構 R M B S	13,474,000	13,944,242	
2 4	住宅機構 R M B S	27,198,000	28,239,683	
2 6	住宅機構 R M B S	42,663,000	44,318,324	
2 7	住宅機構 R M B S	15,060,000	15,681,978	
2 8	住宅機構 R M B S	17,552,000	18,406,782	
2 9	住宅機構 R M B S	19,127,000	20,100,564	
3 0	住宅機構 R M B S	18,619,000	19,562,983	
3 2	住宅機構 R M B S	36,964,000	38,605,201	
3 5	住宅機構 R M B S	18,758,000	19,615,240	
3 6	住宅機構 R M B S	18,002,000	18,761,684	
4 3	住宅機構 R M B S	23,228,000	24,175,702	
4 6	住宅機構 R M B S	17,997,000	18,792,467	
4 8	住宅機構 R M B S	34,038,000	35,511,845	
4 9	住宅機構 R M B S	17,328,000	18,019,387	
5 1	住宅機構 R M B S	37,842,000	39,302,701	
5 5	住宅機構 R M B S	50,862,000	52,504,842	
5 7	住宅機構 R M B S	24,260,000	25,072,710	
5 8	住宅機構 R M B S	27,149,000	28,028,627	
5 9	住宅機構 R M B S	51,576,000	53,334,741	
6 0	住宅機構 R M B S	78,492,000	80,815,363	
6 1	住宅機構 R M B S	26,357,000	27,042,282	
6 7	住宅機構 R M B S	33,679,000	34,160,609	
6 9	住宅機構 R M B S	70,396,000	72,078,464	
7 0	住宅機構 R M B S	60,828,000	62,348,700	
7 3	住宅機構 R M B S	34,698,000	35,582,799	
9 9	住宅機構 R M B S	54,352,000	54,047,628	
1 2 3	住宅機構 R M B S	71,928,000	68,827,903	
1 2 4	住宅機構 R M B S	71,666,000	68,347,864	
1 2 5	住宅機構 R M B S	71,591,000	68,290,654	
1 2 7	住宅機構 R M B S	73,841,000	70,193,254	
1 2 8	住宅機構 R M B S	72,354,000	68,946,126	
1 2 9	住宅機構 R M B S	74,115,000	70,735,356	
1 3 7	住宅機構 R M B S	76,524,000	72,804,933	
1 6 7	住宅機構 R M B S	89,129,000	83,398,005	
1 8 3	住宅機構 R M B S	191,074,000	181,749,588	
1 8 6	住宅機構 R M B S	96,538,000	93,690,129	
8 5	中日本高速道	300,000,000	299,222,100	
	特殊債券 小計		9,472,283,708	
社債券	8 6 東日本高速道	200,000,000	198,498,000	
	2 3 西日本高速道	100,000,000	100,402,900	

1 3	大和ハウス	100,000,000	99,411,100	
1 7	アサヒグループHD	200,000,000	198,822,400	
3 0	東レ	100,000,000	99,564,200	
2 4	三菱ケミカルホールデイ	100,000,000	99,090,000	
3 2	住友電工	100,000,000	98,765,400	
1 6	小松製作所	100,000,000	98,819,700	
1 6	日立製作所	100,000,000	100,177,700	
2 2	パナソニック	100,000,000	98,534,500	
9	T D K	100,000,000	97,434,800	
6 3	三井物産	100,000,000	106,710,400	
8	みずほコーポレート	100,000,000	107,995,200	
1	三井住友F G劣後	100,000,000	100,357,200	
8	住友信託 劣後	100,000,000	106,241,400	
1	みずほF G劣後	100,000,000	100,351,400	
9	みずほ銀行劣後	100,000,000	106,305,800	
1 7	N T Tファイナンス	200,000,000	198,009,600	
7 3	ホンダファイナンス	200,000,000	197,886,600	
2 0 7	オリックス	200,000,000	198,156,800	
2	三菱H C キャピタル	200,000,000	197,482,200	
5 8	三菱地所	100,000,000	116,025,500	
1 3 5	三菱地所	200,000,000	190,480,000	
1 0	東急	100,000,000	94,491,000	
3 8	京王電鉄	100,000,000	99,296,900	
1 1 0	東日本旅客鉄	100,000,000	99,913,600	
1 6 9	東日本旅客鉄	200,000,000	188,428,600	
6 0	西日本旅客鉄	200,000,000	193,070,400	
4 1	東海旅客鉄道	100,000,000	108,104,800	
4 2	東海旅客鉄道	100,000,000	109,095,000	
4 5	東京地下鉄	100,000,000	95,788,700	
6 4	阪急阪神H L D G	100,000,000	99,096,200	
3 1	K D D I	200,000,000	199,160,200	
5 4 6	中部電力	200,000,000	189,817,000	
5 5 3	中部電力	200,000,000	199,078,600	
5 5 0	関西電力	300,000,000	299,251,800	
5 0 8	東北電力	200,000,000	198,070,400	
5 4 7	東北電力	100,000,000	99,086,100	
4 9 6	九州電力	300,000,000	284,989,500	
5 6	東京電力P G	200,000,000	202,614,000	
6 6	東京電力P G	100,000,000	99,019,100	
4 1	大阪瓦斯	200,000,000	189,165,800	
7	ファーストリテイリング	100,000,000	98,903,300	
	社債券 小計		6,161,963,800	
	合 計		127,296,557,968	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

## ( 1 ) 貸借対照表

( 単位 : 円 )

	( 2022年9月12日現在 )	( 2023年9月11日現在 )
資産の部		
流動資産		
預金	40,066,476	37,148,722
金銭信託	4,633,429	3,665,467
コール・ローン	130,230,195	155,170,920
国債証券	26,458,313,532	18,922,834,265
派生商品評価勘定	-	33,548,149
未収入金	347,174	-
未収利息	122,417,680	112,115,149
前払費用	32,362,060	18,930,362
流動資産合計	26,788,370,546	19,283,413,034
資産合計	26,788,370,546	19,283,413,034
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	677,805,939	97,323,664
未払金	4,017,074	-
未払解約金	78,399,999	3,864,250
その他未払費用	963	1,478
流動負債合計	760,223,975	101,189,392
負債合計	760,223,975	101,189,392
純資産の部		
元本等		
元本	20,045,986,946	15,785,182,828
剰余金		
剰余金又は欠損金 ( )	5,982,159,625	3,397,040,814
元本等合計	26,028,146,571	19,182,223,642
純資産合計	26,028,146,571	19,182,223,642
負債純資産合計	26,788,370,546	19,283,413,034

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2022年9月13日 至 2023年9月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p>

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

（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9月12日現在）	（2023年9月11日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	20,045,986,946口	15,785,182,828口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2984円 （1万口当たりの純資産額12,984円）	1口当たり純資産額 1.2152円 （1万口当たりの純資産額12,152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9月13日 至 2023年9月11日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券</p> <p>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引</p> <p>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p>

	<p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
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9月11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)

(2022年9月12日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

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

(2023年9月11日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
	為替予約取引				
	売建				
	アメリカ・ドル	9,145,118,008	-	9,240,925,927	95,807,919
	カナダ・ドル	382,479,901	-	383,646,480	1,166,579
	オーストラリア・ド ル	282,744,725	-	282,073,120	671,605
	シンガポール・ドル	185,858,965	-	185,911,509	52,544
	ニュージーランド・ ドル	43,144,661	-	43,235,150	90,489

市場取引以 外の取引	イギリス・ポンド	955,003,538	-	950,939,600	4,063,938
	イスラエル・シケ ル	57,719,381	-	57,428,622	290,759
	デンマーク・クロー ネ	61,506,134	-	61,302,933	203,201
	ノルウェー・クロー ネ	30,947,347	-	31,153,480	206,133
	スウェーデン・ク ローナ	36,574,925	-	36,457,668	117,257
	メキシコ・ペソ	195,309,807	-	189,380,025	5,929,782
	オフショア・人民元	1,260,443,264	-	1,259,056,848	1,386,416
	ポーランド・ズロチ	96,537,316	-	93,305,575	3,231,741
	ユーロ	6,332,967,693	-	6,315,314,243	17,653,450
	小計	19,066,355,665	-	19,130,131,180	63,775,515
	合 計	19,066,355,665	-	19,130,131,180	63,775,515

## (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9月13日 至 2023年9月11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9月12日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	17,348,369,874円
同期中における追加設定元本額	10,681,951,147円
同期中における一部解約元本額	7,984,334,075円

2022年9月12日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	3,259,160,926円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	2,004,157,726円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	812,805,747円
イオン・バランス戦略ファンド	1,038,428,645円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	2,458,848,150円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	922,475,104円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	1,688,186,609円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	414,613,223円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	135,457,382円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	58,264,769円
日興FWS・先進国債インデックス（為替ヘッジあり）	509,015,574円
SMAM・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	1,154,681,049円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	885,316円
SMAM・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞	4,427,439,289円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	354,629,080円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04＜適格機関投資家限定＞	354,304,415円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞	452,633,942円
合計	20,045,986,946円

(2023年9月11日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	20,045,986,946円
同期中における追加設定元本額	10,298,549,113円
同期中における一部解約元本額	14,559,353,231円
2023年9月11日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	1,757,814,559円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	592,185,183円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	11,933,989円
イオン・バランス戦略ファンド	864,182,580円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	1,350,410,842円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	586,893,997円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	1,173,539,486円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	332,985,607円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	52,630,230円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	85,609,309円
日興FWS・先進国債インデックス（為替ヘッジあり）	613,150,901円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）	2,955,830円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）	15,393,411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）	39,736,679円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）	9,542,434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）	1,224,416円
SMAM・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	1,089,575,826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＞	5,526,794,175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>	608,135,876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>	382,886,890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>	612,248,747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>	74,345,254円
合計	15,785,182,828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 05/31/25	370,000.00	340,729.30	
		T 0.25 06/30/25	650,000.00	596,830.00	
		T 0.25 07/31/25	350,000.00	320,260.50	
		T 0.25 08/31/25	590,000.00	538,074.10	
		T 0.25 09/30/25	290,000.00	263,830.40	
		T 0.25 10/31/25	420,000.00	380,730.00	
		T 0.375 01/31/26	300,000.00	270,246.00	
		T 0.375 04/30/25	520,000.00	481,556.40	
		T 0.375 07/31/27	400,000.00	341,288.00	
		T 0.375 09/15/24	100,000.00	95,086.00	
		T 0.375 09/30/27	470,000.00	398,616.40	
		T 0.375 11/30/25	510,000.00	462,126.30	
		T 0.375 12/31/25	500,000.00	452,185.00	
		T 0.5 02/28/26	550,000.00	495,577.50	
		T 0.5 03/31/25	920,000.00	856,510.80	
		T 0.5 04/30/27	30,000.00	25,958.10	
		T 0.5 05/31/27	40,000.00	34,506.00	
		T 0.5 06/30/27	310,000.00	266,696.10	
		T 0.5 08/31/27	340,000.00	290,700.00	
		T 0.5 10/31/27	400,000.00	340,076.00	
		T 0.625 03/31/27	120,000.00	104,629.20	
		T 0.625 05/15/30	300,000.00	235,896.00	
		T 0.625 07/31/26	70,000.00	62,414.80	
		T 0.625 08/15/30	750,000.00	585,525.00	
		T 0.625 11/30/27	280,000.00	238,688.80	
		T 0.625 12/31/27	350,000.00	297,608.50	
		T 0.75 01/31/28	460,000.00	392,311.00	
		T 0.75 03/31/26	530,000.00	479,856.70	
		T 0.75 04/30/26	500,000.00	451,070.00	
T 0.75 05/31/26	30,000.00	26,987.10			

T 0.75 08/31/26	460,000.00	410,563.80	
T 0.75 11/15/24	100,000.00	94,794.00	
T 0.875 06/30/26	390,000.00	351,577.20	
T 0.875 09/30/26	540,000.00	483,046.20	
T 0.875 11/15/30	280,000.00	221,908.40	
T 1 12/15/24	460,000.00	436,020.20	
T 1.125 02/15/31	790,000.00	635,081.00	
T 1.125 02/28/27	280,000.00	249,396.00	
T 1.125 02/29/28	540,000.00	467,434.80	
T 1.125 05/15/40	50,000.00	30,393.50	
T 1.125 08/15/40	160,000.00	96,404.80	
T 1.125 08/31/28	650,000.00	554,859.50	
T 1.125 10/31/26	650,000.00	583,979.50	
T 1.25 03/31/28	460,000.00	399,629.60	
T 1.25 04/30/28	280,000.00	242,718.00	
T 1.25 05/15/50	470,000.00	239,700.00	
T 1.25 05/31/28	580,000.00	501,740.60	
T 1.25 06/30/28	330,000.00	284,790.00	
T 1.25 08/15/31	970,000.00	774,671.10	
T 1.25 08/31/24	50,000.00	48,039.00	
T 1.25 09/30/28	40,000.00	34,279.60	
T 1.25 11/30/26	420,000.00	378,012.60	
T 1.25 12/31/26	530,000.00	476,273.90	
T 1.375 08/15/50	450,000.00	237,213.00	
T 1.375 08/31/26	240,000.00	218,263.20	
T 1.375 10/31/28	260,000.00	223,771.60	
T 1.375 11/15/31	1,040,000.00	833,414.40	
T 1.375 11/15/40	50,000.00	31,336.50	
T 1.375 12/31/28	510,000.00	437,600.40	
T 1.5 02/15/25	370,000.00	351,100.40	
T 1.5 02/15/30	570,000.00	479,421.30	
T 1.5 11/30/28	380,000.00	328,624.00	
T 1.625 05/15/26	120,000.00	110,690.40	
T 1.625 05/15/31	680,000.00	563,495.60	
T 1.625 08/15/29	220,000.00	189,087.80	
T 1.625 09/30/26	110,000.00	100,709.40	
T 1.625 11/15/50	310,000.00	174,979.50	
T 1.625 11/30/26	350,000.00	318,839.50	
T 1.75 01/31/29	540,000.00	471,506.40	
T 1.75 03/15/25	600,000.00	570,264.00	
T 1.75 08/15/41	210,000.00	138,411.00	
T 1.875 02/15/32	950,000.00	789,383.50	
T 1.875 02/15/41	320,000.00	218,099.20	
T 1.875 02/15/51	640,000.00	385,369.60	

T 1.875 02/28/27	370,000.00	338,087.50	
T 1.875 02/28/29	620,000.00	544,254.60	
T 1.875 06/30/26	200,000.00	185,460.00	
T 1.875 11/15/51	470,000.00	281,830.80	
T 2 02/15/50	470,000.00	294,187.10	
T 2 08/15/51	230,000.00	142,563.20	
T 2 11/15/26	490,000.00	452,196.50	
T 2 11/15/41	170,000.00	116,722.00	
T 2.125 05/31/26	320,000.00	299,011.20	
T 2.25 02/15/52	500,000.00	329,450.00	
T 2.25 05/15/41	40,000.00	28,943.60	
T 2.25 08/15/46	250,000.00	168,827.50	
T 2.375 02/15/42	200,000.00	145,984.00	
T 2.375 03/31/29	290,000.00	261,084.10	
T 2.375 04/30/26	50,000.00	47,097.50	
T 2.375 05/15/29	100,000.00	89,925.00	
T 2.375 05/15/51	590,000.00	400,669.00	
T 2.375 11/15/49	180,000.00	123,134.40	
T 2.5 02/15/45	220,000.00	158,481.40	
T 2.5 02/15/46	340,000.00	242,474.40	
T 2.5 03/31/27	40,000.00	37,323.20	
T 2.5 05/15/46	230,000.00	163,783.00	
T 2.625 01/31/26	230,000.00	218,642.60	
T 2.625 04/15/25	700,000.00	673,162.00	
T 2.625 05/31/27	280,000.00	261,590.00	
T 2.625 07/31/29	420,000.00	381,696.00	
T 2.625 12/31/25	110,000.00	104,705.70	
T 2.75 02/15/28	420,000.00	391,137.60	
T 2.75 04/30/27	290,000.00	272,484.00	
T 2.75 05/15/25	890,000.00	856,411.40	
T 2.75 05/31/29	430,000.00	394,193.90	
T 2.75 07/31/27	350,000.00	327,848.50	
T 2.75 08/15/32	100,000.00	88,683.00	
T 2.75 08/15/42	230,000.00	177,583.00	
T 2.75 08/15/47	250,000.00	185,790.00	
T 2.75 11/15/47	250,000.00	185,565.00	
T 2.875 04/30/29	400,000.00	369,504.00	
T 2.875 05/15/32	910,000.00	817,398.40	
T 2.875 05/15/43	290,000.00	226,777.10	
T 2.875 05/15/49	410,000.00	311,493.40	
T 2.875 05/15/52	520,000.00	394,446.00	
T 2.875 06/15/25	420,000.00	404,510.40	
T 2.875 07/31/25	300,000.00	288,498.00	
T 2.875 08/15/28	300,000.00	279,408.00	

T 2.875 08/15/45	110,000.00	84,459.10	
T 3 02/15/47	150,000.00	116,997.00	
T 3 02/15/48	360,000.00	280,213.20	
T 3 02/15/49	370,000.00	287,867.40	
T 3 05/15/45	290,000.00	228,067.60	
T 3 05/15/47	300,000.00	233,847.00	
T 3 07/15/25	610,000.00	588,277.90	
T 3 08/15/52	160,000.00	124,656.00	
T 3 09/30/25	620,000.00	596,514.40	
T 3 11/15/44	220,000.00	173,782.40	
T 3.125 02/15/42	150,000.00	123,799.50	
T 3.125 05/15/48	420,000.00	334,488.00	
T 3.125 08/15/44	320,000.00	258,499.20	
T 3.125 08/31/27	430,000.00	408,229.10	
T 3.125 08/31/29	220,000.00	205,427.20	
T 3.125 11/15/28	100,000.00	94,015.00	
T 3.125 11/15/41	210,000.00	174,077.40	
T 3.25 05/15/42	300,000.00	251,430.00	
T 3.25 06/30/27	280,000.00	267,540.00	
T 3.25 06/30/29	430,000.00	404,685.90	
T 3.25 08/31/24	20,000.00	19,589.00	
T 3.375 05/15/33	720,000.00	669,765.60	
T 3.375 05/15/44	300,000.00	252,690.00	
T 3.375 08/15/42	430,000.00	366,428.80	
T 3.375 11/15/48	300,000.00	249,984.00	
T 3.5 01/31/28	470,000.00	451,839.20	
T 3.5 01/31/30	150,000.00	142,675.50	
T 3.5 02/15/39	80,000.00	72,484.00	
T 3.5 04/30/28	270,000.00	259,389.00	
T 3.625 02/15/44	270,000.00	236,606.40	
T 3.625 02/15/53	150,000.00	132,198.00	
T 3.625 03/31/28	30,000.00	28,981.50	
T 3.625 03/31/30	210,000.00	201,114.90	
T 3.625 05/15/26	580,000.00	563,800.60	
T 3.625 05/15/53	250,000.00	220,507.50	
T 3.625 05/31/28	400,000.00	386,500.00	
T 3.625 08/15/43	230,000.00	202,038.90	
T 3.875 01/15/26	320,000.00	313,123.20	
T 3.875 02/15/43	220,000.00	201,058.00	
T 3.875 03/31/25	470,000.00	460,900.80	
T 3.875 04/30/25	700,000.00	686,175.00	
T 3.875 05/15/43	450,000.00	410,976.00	
T 3.875 08/15/33	150,000.00	145,393.50	
T 3.875 08/15/40	40,000.00	37,361.60	

T 3.875 09/30/29	150,000.00	145,815.00	
T 3.875 11/30/27	30,000.00	29,279.10	
T 3.875 11/30/29	440,000.00	427,684.40	
T 3.875 12/31/27	300,000.00	292,839.00	
T 3.875 12/31/29	500,000.00	485,895.00	
T 4 02/15/26	640,000.00	628,000.00	
T 4 02/28/30	650,000.00	636,187.50	
T 4 02/29/28	400,000.00	392,624.00	
T 4 06/30/28	370,000.00	363,177.20	
T 4 10/31/29	300,000.00	293,646.00	
T 4 11/15/42	500,000.00	466,080.00	
T 4 11/15/52	380,000.00	358,784.60	
T 4 12/15/25	720,000.00	706,608.00	
T 4.125 01/31/25	1,250,000.00	1,231,050.00	
T 4.125 07/31/28	600,000.00	592,218.00	
T 4.125 09/30/27	350,000.00	344,925.00	
T 4.125 10/31/27	200,000.00	197,062.00	
T 4.125 11/15/32	730,000.00	721,130.50	
T 4.25 05/15/39	70,000.00	69,160.00	
T 4.25 05/31/25	570,000.00	561,957.30	
T 4.25 11/15/40	140,000.00	137,160.80	
T 4.25 12/31/24	1,200,000.00	1,184,004.00	
T 4.375 05/15/40	140,000.00	139,490.40	
T 4.375 05/15/41	30,000.00	29,727.30	
T 4.375 11/15/39	80,000.00	79,902.40	
T 4.5 02/15/36	50,000.00	51,738.00	
T 4.5 11/15/25	400,000.00	396,560.00	
T 4.625 02/15/40	100,000.00	102,826.00	
T 4.625 02/28/25	950,000.00	942,077.00	
T 4.625 03/15/26	100,000.00	99,601.00	
T 4.625 06/30/25	500,000.00	496,230.00	
アメリカ・ドル小計	70,820,000.00	62,308,375.80 (9,157,461,991)	
カナダ・ドル	CAN 0.25 03/01/26	70,000.00	63,268.80
	CAN 0.5 09/01/25	180,000.00	166,143.60
	CAN 0.5 12/01/30	170,000.00	135,260.50
	CAN 1 06/01/27	140,000.00	125,512.80
	CAN 1.25 03/01/25	60,000.00	57,011.40
	CAN 1.25 03/01/27	160,000.00	144,977.60
	CAN 1.25 06/01/30	150,000.00	127,765.50
	CAN 1.5 06/01/26	20,000.00	18,582.00
	CAN 1.5 06/01/31	390,000.00	331,886.10
	CAN 1.5 09/01/24	230,000.00	222,398.50
	CAN 1.5 12/01/31	110,000.00	92,849.90

	CAN 1.75 12/01/53	270,000.00	183,189.60	
	CAN 2 06/01/28	60,000.00	55,183.20	
	CAN 2 06/01/32	70,000.00	61,154.10	
	CAN 2 12/01/51	130,000.00	95,189.90	
	CAN 2.25 06/01/25	70,000.00	67,228.00	
	CAN 2.25 06/01/29	60,000.00	55,370.40	
	CAN 2.25 12/01/29	150,000.00	137,617.50	
	CAN 2.5 12/01/32	130,000.00	118,008.80	
	CAN 2.75 06/01/33	200,000.00	185,086.00	
	CAN 2.75 09/01/27	10,000.00	9,511.90	
	CAN 2.75 12/01/48	90,000.00	78,456.60	
	CAN 3 04/01/26	320,000.00	309,232.00	
	CAN 3 10/01/25	50,000.00	48,442.00	
	CAN 3.25 09/01/28	50,000.00	48,410.00	
	CAN 3.5 03/01/28	220,000.00	215,316.20	
	CAN 3.5 12/01/45	90,000.00	89,011.80	
	CAN 3.75 05/01/25	150,000.00	147,574.50	
	CAN 5 06/01/37	90,000.00	102,665.70	
	CANADA 2.75 12/01/64	50,000.00	41,939.50	
	カナダ・ドル小計	3,940,000.00	3,534,244.40 (381,132,916)	
オーストラ リア・ドル	ACGB 0.25 11/21/25	200,000.00	185,134.00	
	ACGB 0.5 09/21/26	150,000.00	136,047.00	
	ACGB 1 11/21/31	130,000.00	102,768.90	
	ACGB 1 12/21/30	170,000.00	138,327.30	
	ACGB 1.25 05/21/32	280,000.00	222,994.80	
	ACGB 1.5 06/21/31	260,000.00	216,873.80	
	ACGB 1.75 06/21/51	160,000.00	90,988.80	
	ACGB 1.75 11/21/32	150,000.00	123,498.00	
	ACGB 2.75 05/21/41	30,000.00	23,944.80	
	ACGB 2.75 06/21/35	120,000.00	104,560.80	
	ACGB 2.75 11/21/27	190,000.00	182,420.90	
	ACGB 2.75 11/21/28	140,000.00	132,986.00	
	ACGB 2.75 11/21/29	260,000.00	243,783.80	
	ACGB 3 03/21/47	70,000.00	55,132.00	
	ACGB 3 11/21/33	140,000.00	127,464.40	
	ACGB 3.25 04/21/25	150,000.00	148,498.50	
	ACGB 3.25 04/21/29	130,000.00	126,057.10	
	ACGB 3.5 12/21/34	30,000.00	28,346.70	
	ACGB 3.75 04/21/37	150,000.00	142,582.50	
	ACGB 3.75 05/21/34	150,000.00	145,555.50	
ACGB 4.25 04/21/26	130,000.00	131,497.60		
ACGB 4.75 04/21/27	160,000.00	165,160.00		

オーストラリア・ドル小計		3,350,000.00	2,974,623.20 (279,614,581)	
シンガポール・ドル	SIGB 0.5 11/01/25	70,000.00	65,758.00	
	SIGB 1.875 03/01/50	60,000.00	47,100.00	
	SIGB 1.875 10/01/51	30,000.00	23,374.20	
	SIGB 2.125 06/01/26	200,000.00	193,340.00	
	SIGB 2.25 08/01/36	250,000.00	225,750.00	
	SIGB 2.375 06/01/25	190,000.00	186,500.20	
	SIGB 2.375 07/01/39	130,000.00	117,757.90	
	SIGB 2.625 05/01/28	140,000.00	136,892.00	
	SIGB 2.75 03/01/46	120,000.00	113,760.00	
	SIGB 2.875 07/01/29	210,000.00	206,472.00	
	SIGB 2.875 09/01/30	320,000.00	313,440.00	
	SIGB 3 08/01/72	10,000.00	9,985.00	
	SIGB 3.375 09/01/33	80,000.00	81,118.40	
シンガポール・ドル小計		1,810,000.00	1,721,247.70 (185,498,866)	
ニュージーランド・ドル	NZGB 0.25 05/15/28	140,000.00	112,758.80	
	NZGB 0.5 05/15/26	120,000.00	106,136.40	
	NZGB 1.75 05/15/41	20,000.00	12,212.00	
	NZGB 2 05/15/32	200,000.00	158,880.00	
	NZGB 2.75 04/15/25	30,000.00	28,764.00	
	NZGB 2.75 04/15/37	70,000.00	54,210.80	
	NZGB 2.75 05/15/51	30,000.00	19,546.20	
ニュージーランド・ドル小計		610,000.00	492,508.20 (42,749,712)	
イギリス・ bond	UK TSY GILT 1.125 01/31/39	40,000.00	24,642.00	
	UKT 0.125 01/30/26	240,000.00	216,177.60	
	UKT 0.125 01/31/28	50,000.00	41,489.50	
	UKT 0.25 07/31/31	120,000.00	87,478.80	
	UKT 0.375 10/22/26	160,000.00	140,595.20	
	UKT 0.375 10/22/30	70,000.00	53,227.30	
	UKT 0.5 01/31/29	170,000.00	138,074.00	
	UKT 0.5 10/22/61	140,000.00	40,471.20	
	UKT 0.625 06/07/25	100,000.00	93,164.00	
	UKT 0.625 07/31/35	190,000.00	122,852.10	
	UKT 0.625 10/22/50	80,000.00	30,780.80	
	UKT 0.875 01/31/46	220,000.00	104,374.60	
	UKT 0.875 10/22/29	100,000.00	81,655.00	
	UKT 1 01/31/32	250,000.00	191,232.50	
	UKT 1.125 10/22/73	90,000.00	32,065.20	
	UKT 1.25 07/22/27	170,000.00	150,815.50	
	UKT 1.25 07/31/51	200,000.00	94,328.00	
UKT 1.25 10/22/41	180,000.00	105,424.20		

UKT 1.5 07/22/26	110,000.00	101,076.80	
UKT 1.5 07/22/47	110,000.00	59,754.20	
UKT 1.5 07/31/53	20,000.00	9,900.60	
UKT 1.625 10/22/28	70,000.00	61,310.20	
UKT 1.625 10/22/71	130,000.00	59,189.00	
UKT 1.75 01/22/49	110,000.00	62,381.00	
UKT 1.75 07/22/57	120,000.00	62,391.60	
UKT 1.75 09/07/37	170,000.00	120,455.20	
UKT 2 09/07/25	110,000.00	104,157.90	
UKT 2.5 07/22/65	120,000.00	75,232.80	
UKT 3.25 01/22/44	90,000.00	72,720.00	
UKT 3.25 01/31/33	260,000.00	236,912.00	
UKT 3.5 01/22/45	120,000.00	100,102.80	
UKT 3.5 07/22/68	140,000.00	113,506.40	
UKT 3.5 10/22/25	360,000.00	348,937.20	
UKT 3.75 01/29/38	40,000.00	36,246.40	
UKT 3.75 07/22/52	40,000.00	34,112.00	
UKT 3.75 10/22/53	170,000.00	144,319.80	
UKT 4 01/22/60	110,000.00	98,851.50	
UKT 4.125 01/29/27	80,000.00	78,437.60	
UKT 4.25 03/07/36	180,000.00	175,480.20	
UKT 4.25 06/07/32	210,000.00	208,998.30	
UKT 4.25 09/07/39	130,000.00	123,991.40	
UKT 4.25 12/07/27	80,000.00	79,291.20	
UKT 4.25 12/07/49	90,000.00	83,681.10	
UKT 4.5 06/07/28	150,000.00	149,109.00	
UKT 4.5 09/07/34	100,000.00	100,277.00	
UKT 4.5 12/07/42	170,000.00	165,693.90	
UKT 4.75 12/07/30	110,000.00	112,901.80	
UKT 4.75 12/07/38	110,000.00	111,544.40	
UKT 6 12/07/28	100,000.00	107,239.00	
イギリス・ボンド小計	6,480,000.00	5,147,049.80 (944,689,520)	
イスラエル・シュケル	ILGOV 0.5 02/27/26	160,000.00	146,136.00
	ILGOV 0.5 04/30/25	210,000.00	197,322.30
	ILGOV 1 03/31/30	210,000.00	174,711.60
	ILGOV 1.3 04/30/32	120,000.00	96,831.60
	ILGOV 1.5 05/31/37	70,000.00	51,007.60
	ILGOV 1.75 08/31/25	150,000.00	142,797.00
	ILGOV 2 03/31/27	140,000.00	130,886.00
	ILGOV 2.25 09/28/28	160,000.00	147,806.40
	ILGOV 2.8 11/29/52	120,000.00	89,630.40
	ILGOV 3.75 03/31/47	200,000.00	184,086.00
	ILGOV 6.25 10/30/26	110,000.00	117,033.40



イスラエル・シュケル小計		1,650,000.00	1,478,248.30 (56,389,851)	
デンマーク・クローネ	DGB 0 11/15/24	160,000.00	153,977.60	
	DGB 0 11/15/31	40,000.00	32,021.60	
	DGB 0.25 11/15/52	410,000.00	202,790.10	
	DGB 0.5 11/15/27	570,000.00	519,366.90	
	DGB 0.5 11/15/29	510,000.00	445,806.30	
	DGB 1.75 11/15/25	590,000.00	573,828.10	
	DGB 4.5 11/15/39	760,000.00	914,204.00	
デンマーク・クローネ小計		3,040,000.00	2,841,994.60 (60,022,926)	
ノルウェー・クローネ	NGB 1.25 09/17/31	390,000.00	318,563.70	
	NGB 1.375 08/19/30	180,000.00	152,100.00	
	NGB 1.5 02/19/26	210,000.00	196,923.30	
	NGB 1.75 02/17/27	290,000.00	267,910.70	
	NGB 1.75 03/13/25	410,000.00	394,932.50	
	NGB 1.75 09/06/29	370,000.00	326,303.00	
	NGB 2 04/26/28	240,000.00	219,393.60	
	NGB 2.125 05/18/32	200,000.00	173,540.00	
	NGB 3 08/15/33	200,000.00	185,364.00	
ノルウェー・クローネ小計		2,490,000.00	2,235,030.80 (30,776,374)	
スウェーデン・クローナ	SGB 0.125 05/12/31	380,000.00	309,707.60	
	SGB 0.75 05/12/28	410,000.00	371,136.10	
	SGB 0.75 11/12/29	710,000.00	626,418.80	
	SGB 1 11/12/26	730,000.00	682,988.00	
	SGB 2.25 06/01/32	200,000.00	191,004.00	
	SGB 2.5 05/12/25	240,000.00	236,270.40	
	SGB 3.5 03/30/39	290,000.00	309,818.60	
スウェーデン・クローナ小計		2,960,000.00	2,727,343.50 (36,110,028)	
メキシコ・ペソ	MBONO 10 12/05/24	1,350,000.00	1,334,637.00	
	MBONO 5 03/06/25	500,000.00	463,015.00	
	MBONO 5.5 03/04/27	2,200,000.00	1,915,848.00	
	MBONO 5.75 03/05/26	3,640,000.00	3,286,228.40	
	MBONO 7.5 05/26/33	2,300,000.00	2,009,234.00	
	MBONO 7.5 06/03/27	2,800,000.00	2,601,564.00	
	MBONO 7.75 05/29/31	1,640,000.00	1,478,312.40	
	MBONO 7.75 11/13/42	1,400,000.00	1,175,482.00	
	MBONO 7.75 11/23/34	920,000.00	809,784.00	
	MBONO 8 09/05/24	1,200,000.00	1,163,424.00	
	MBONO 8 11/07/47	2,100,000.00	1,795,353.00	
	MBONO 8.5 05/31/29	2,570,000.00	2,448,593.20	
MBONO 8.5 11/18/38	1,700,000.00	1,553,256.00		

メキシコ・ペソ小計		24,320,000.00	22,034,731.00 (184,470,361)	
オフショ ア・人民元	CGB 2.18 08/15/26	1,900,000.00	1,891,450.00	
	CGB 2.18 08/25/25	5,600,000.00	5,594,008.00	
	CGB 2.24 05/25/25	1,000,000.00	999,860.00	
	CGB 2.28 11/25/25	4,800,000.00	4,792,512.00	
	CGB 2.3 05/15/26	3,400,000.00	3,398,266.00	
	CGB 2.4 07/15/28	2,300,000.00	2,292,640.00	
	CGB 2.44 10/15/27	4,400,000.00	4,393,180.00	
	CGB 2.46 02/15/26	1,400,000.00	1,403,976.00	
	CGB 2.47 09/02/24	2,800,000.00	2,810,248.00	
	CGB 2.48 04/15/27	3,700,000.00	3,705,476.00	
	CGB 2.62 06/25/30	2,600,000.00	2,595,450.00	
	CGB 2.64 01/15/28	2,600,000.00	2,615,886.00	
	CGB 2.67 05/25/33	1,200,000.00	1,199,652.00	
	CGB 2.69 08/12/26	1,200,000.00	1,212,624.00	
	CGB 2.79 12/15/29	2,800,000.00	2,823,576.00	
	CGB 2.8 03/25/30	1,800,000.00	1,815,912.00	
	CGB 2.8 11/15/32	4,200,000.00	4,222,680.00	
	CGB 2.91 10/14/28	3,900,000.00	3,971,565.00	
	CGB 3.02 05/27/31	3,500,000.00	3,600,590.00	
	CGB 3.12 10/25/52	1,000,000.00	1,022,170.00	
CGB 3.19 04/15/53	1,300,000.00	1,357,343.00		
CGB 3.72 04/12/51	4,000,000.00	4,505,840.00		
オフショア・人民元小計		61,400,000.00	62,224,904.00 (1,243,222,469)	
ポーランド・ズロチ	POLGB 0.75 04/25/25	580,000.00	544,591.00	
	POLGB 1.25 10/25/30	500,000.00	380,965.00	
	POLGB 1.75 04/25/32	170,000.00	127,041.00	
	POLGB 2.25 10/25/24	310,000.00	301,298.30	
	POLGB 2.5 07/25/27	240,000.00	219,288.00	
	POLGB 2.75 04/25/28	50,000.00	45,331.50	
	POLGB 2.75 10/25/29	430,000.00	375,372.80	
	POLGB 3.75 05/25/27	290,000.00	277,967.90	
	POLGB 7.5 07/25/28	430,000.00	473,533.20	
ポーランド・ズロチ小計		3,000,000.00	2,745,388.70 (93,624,069)	
ユーロ	BGB 0 10/22/27	10,000.00	8,863.70	
	BGB 0 10/22/31	10,000.00	7,798.40	
	BGB 0.1 06/22/30	50,000.00	41,168.00	
	BGB 0.35 06/22/32	220,000.00	173,214.80	
	BGB 0.4 06/22/40	140,000.00	85,167.60	
	BGB 0.5 10/22/24	30,000.00	29,049.90	
	BGB 0.65 06/22/71	30,000.00	11,296.20	

BGB 0.8 06/22/25	250,000.00	239,625.00	
BGB 0.8 06/22/27	100,000.00	92,284.00	
BGB 0.8 06/22/28	170,000.00	154,127.10	
BGB 0.9 06/22/29	160,000.00	142,806.40	
BGB 1.25 04/22/33	100,000.00	84,656.00	
BGB 1.4 06/22/53	180,000.00	108,167.40	
BGB 1.45 06/22/37	10,000.00	7,849.90	
BGB 1.6 06/22/47	100,000.00	68,561.00	
BGB 1.7 06/22/50	10,000.00	6,754.90	
BGB 1.9 06/22/38	100,000.00	81,973.00	
BGB 2.75 04/22/39	160,000.00	145,884.80	
BGB 3 06/22/34	140,000.00	136,228.40	
BGB 3.45 06/22/43	50,000.00	48,982.50	
BGB 3.75 06/22/45	100,000.00	102,924.00	
BGB 4 03/28/32	150,000.00	159,849.00	
BGB 4.5 03/28/26	100,000.00	103,321.00	
BGB 5.5 03/28/28	100,000.00	110,732.00	
BKO 2.5 03/13/25	470,000.00	465,036.80	
BKO 2.8 06/12/25	200,000.00	198,794.00	
BTPS 0 04/01/26	60,000.00	54,684.60	
BTPS 0 08/01/26	10,000.00	9,008.90	
BTPS 0 12/15/24	330,000.00	315,034.50	
BTPS 0.25 03/15/28	130,000.00	111,394.40	
BTPS 0.35 02/01/25	230,000.00	219,693.70	
BTPS 0.45 02/15/29	20,000.00	16,709.80	
BTPS 0.5 02/01/26	360,000.00	334,130.40	
BTPS 0.5 07/15/28	80,000.00	68,531.20	
BTPS 0.6 08/01/31	100,000.00	76,880.00	
BTPS 0.85 01/15/27	230,000.00	209,934.80	
BTPS 0.9 04/01/31	210,000.00	167,580.00	
BTPS 0.95 03/01/37	90,000.00	58,640.40	
BTPS 0.95 06/01/32	120,000.00	92,403.60	
BTPS 0.95 08/01/30	160,000.00	130,998.40	
BTPS 0.95 09/15/27	210,000.00	188,781.60	
BTPS 0.95 12/01/31	100,000.00	78,339.00	
BTPS 1.1 04/01/27	180,000.00	164,784.60	
BTPS 1.35 04/01/30	170,000.00	144,743.10	
BTPS 1.45 03/01/36	20,000.00	14,375.20	
BTPS 1.5 04/30/45	130,000.00	76,277.50	
BTPS 1.5 06/01/25	130,000.00	125,286.20	
BTPS 1.6 06/01/26	130,000.00	123,152.90	
BTPS 1.65 03/01/32	20,000.00	16,534.20	
BTPS 1.8 03/01/41	60,000.00	40,209.60	
BTPS 2 02/01/28	190,000.00	176,871.00	

BTPS 2 12/01/25	220,000.00	212,330.80	
BTPS 2.05 08/01/27	280,000.00	263,631.20	
BTPS 2.1 07/15/26	150,000.00	143,760.00	
BTPS 2.15 03/01/72	50,000.00	27,607.00	
BTPS 2.15 09/01/52	100,000.00	61,378.00	
BTPS 2.25 09/01/36	170,000.00	133,691.40	
BTPS 2.45 09/01/50	50,000.00	33,621.50	
BTPS 2.5 11/15/25	20,000.00	19,521.80	
BTPS 2.5 12/01/24	100,000.00	98,565.00	
BTPS 2.5 12/01/32	20,000.00	17,472.20	
BTPS 2.65 12/01/27	50,000.00	47,932.50	
BTPS 2.7 03/01/47	150,000.00	110,139.00	
BTPS 2.8 03/01/67	90,000.00	60,264.90	
BTPS 2.8 06/15/29	320,000.00	302,412.80	
BTPS 2.8 12/01/28	20,000.00	19,067.20	
BTPS 2.95 09/01/38	200,000.00	166,364.00	
BTPS 3 08/01/29	120,000.00	114,598.80	
BTPS 3.1 03/01/40	270,000.00	224,586.00	
BTPS 3.25 03/01/38	220,000.00	190,049.20	
BTPS 3.25 09/01/46	90,000.00	72,989.10	
BTPS 3.35 03/01/35	20,000.00	18,142.20	
BTPS 3.4 03/28/25	80,000.00	79,591.20	
BTPS 3.4 04/01/28	100,000.00	98,501.00	
BTPS 3.45 03/01/48	10,000.00	8,316.80	
BTPS 3.5 01/15/26	80,000.00	79,717.60	
BTPS 3.8 04/15/26	220,000.00	220,675.40	
BTPS 3.85 09/01/49	10,000.00	8,813.30	
BTPS 3.85 12/15/29	200,000.00	199,052.00	
BTPS 4 04/30/35	120,000.00	116,055.60	
BTPS 4 10/30/31	120,000.00	119,438.40	
BTPS 4.4 05/01/33	280,000.00	284,004.00	
BTPS 4.45 09/01/43	130,000.00	126,456.20	
BTPS 4.5 03/01/26	130,000.00	132,525.90	
BTPS 4.5 10/01/53	70,000.00	67,294.50	
BTPS 4.75 09/01/28	200,000.00	208,704.00	
BTPS 5 03/01/25	250,000.00	254,490.00	
BTPS 5 08/01/34	250,000.00	264,037.50	
BTPS 5 08/01/39	220,000.00	230,766.80	
BTPS 5 09/01/40	180,000.00	188,830.80	
BTPS 5.25 11/01/29	250,000.00	269,220.00	
BTPS 5.75 02/01/33	240,000.00	268,677.60	
BTPS 6 05/01/31	250,000.00	282,845.00	
BTPS 6.5 11/01/27	190,000.00	210,442.10	
DBR 0 02/15/30	160,000.00	136,368.00	

DBR 0 02/15/31	240,000.00	199,644.00	
DBR 0 02/15/32	250,000.00	202,662.50	
DBR 0 05/15/35	260,000.00	191,357.40	
DBR 0 05/15/36	30,000.00	21,426.90	
DBR 0 08/15/26	220,000.00	203,068.80	
DBR 0 08/15/29	250,000.00	215,617.50	
DBR 0 08/15/30	170,000.00	143,174.00	
DBR 0 08/15/30	110,000.00	92,764.10	
DBR 0 08/15/31	180,000.00	147,862.80	
DBR 0 08/15/31	200,000.00	164,458.00	
DBR 0 08/15/50	100,000.00	49,422.00	
DBR 0 08/15/50	130,000.00	64,568.40	
DBR 0 08/15/52	140,000.00	65,536.80	
DBR 0 11/15/27	220,000.00	197,476.40	
DBR 0 11/15/28	10,000.00	8,772.00	
DBR 0.25 02/15/27	20,000.00	18,411.20	
DBR 0.25 02/15/29	280,000.00	247,828.00	
DBR 0.25 08/15/28	150,000.00	134,152.50	
DBR 0.5 02/15/25	200,000.00	192,516.00	
DBR 0.5 02/15/26	100,000.00	94,455.00	
DBR 0.5 02/15/28	100,000.00	91,362.00	
DBR 1 05/15/38	240,000.00	190,022.40	
DBR 1 08/15/25	20,000.00	19,239.20	
DBR 1.25 08/15/48	30,000.00	22,281.90	
DBR 1.7 08/15/32	280,000.00	261,349.20	
DBR 1.8 08/15/53	270,000.00	219,672.00	
DBR 2.1 11/15/29	130,000.00	126,588.80	
DBR 2.3 02/15/33	120,000.00	117,320.40	
DBR 2.3 02/15/33	90,000.00	88,083.00	
DBR 2.5 07/04/44	350,000.00	337,071.00	
DBR 2.5 08/15/46	200,000.00	192,832.00	
DBR 4 01/04/37	260,000.00	296,823.80	
DBR 4.25 07/04/39	90,000.00	107,100.90	
DBR 4.75 07/04/28	170,000.00	186,602.20	
DBR 4.75 07/04/40	160,000.00	202,598.40	
DBR 5.625 01/04/28	160,000.00	179,433.60	
DBR 6.25 01/04/30	130,000.00	157,879.80	
DBR 6.5 07/04/27	160,000.00	181,553.60	
FRANCE O.A.T. 0.75 05/25/53	30,000.00	14,842.50	
FRTR 0 02/25/25	260,000.00	247,915.20	
FRTR 0 02/25/26	550,000.00	510,345.00	
FRTR 0 02/25/27	470,000.00	424,414.70	
FRTR 0 03/25/25	360,000.00	342,522.00	
FRTR 0 05/25/32	310,000.00	238,799.20	

FRTR 0 11/25/29	330,000.00	275,751.30	
FRTR 0 11/25/30	610,000.00	493,898.70	
FRTR 0 11/25/31	340,000.00	266,495.40	
FRTR 0.25 11/25/26	150,000.00	137,454.00	
FRTR 0.5 05/25/26	270,000.00	252,228.60	
FRTR 0.5 05/25/29	200,000.00	174,820.00	
FRTR 0.5 05/25/40	380,000.00	239,555.80	
FRTR 0.5 05/25/72	80,000.00	27,704.00	
FRTR 0.5 06/25/44	150,000.00	85,093.50	
FRTR 0.75 02/25/28	130,000.00	118,175.20	
FRTR 0.75 05/25/28	390,000.00	352,782.30	
FRTR 0.75 05/25/52	280,000.00	142,175.60	
FRTR 0.75 11/25/28	350,000.00	313,523.00	
FRTR 1 11/25/25	300,000.00	286,629.00	
FRTR 1.25 05/25/34	110,000.00	90,822.60	
FRTR 1.25 05/25/36	20,000.00	15,770.80	
FRTR 1.25 05/25/38	240,000.00	180,787.20	
FRTR 1.5 05/25/50	290,000.00	189,892.00	
FRTR 1.75 05/25/66	120,000.00	75,280.80	
FRTR 1.75 06/25/39	360,000.00	289,796.40	
FRTR 1.75 11/25/24	120,000.00	117,674.40	
FRTR 2 11/25/32	680,000.00	621,547.20	
FRTR 2.5 05/25/30	320,000.00	311,465.60	
FRTR 2.5 05/25/43	120,000.00	102,985.20	
FRTR 2.5 09/24/26	310,000.00	304,816.80	
FRTR 2.75 02/25/29	150,000.00	148,318.50	
FRTR 2.75 10/25/27	470,000.00	466,056.70	
FRTR 3 05/25/54	40,000.00	35,658.00	
FRTR 3.25 05/25/45	280,000.00	269,385.20	
FRTR 3.5 04/25/26	240,000.00	242,383.20	
FRTR 4 04/25/55	20,000.00	21,595.20	
FRTR 4 04/25/60	120,000.00	130,190.40	
FRTR 4 10/25/38	210,000.00	225,302.70	
FRTR 4.5 04/25/41	280,000.00	318,511.20	
FRTR 4.75 04/25/35	100,000.00	114,301.00	
FRTR 5.5 04/25/29	340,000.00	383,975.60	
FRTR 5.75 10/25/32	140,000.00	169,356.60	
FRTR 6 10/25/25	180,000.00	190,236.60	
IRISH 0 10/18/31	50,000.00	39,491.50	
IRISH 0.2 05/15/27	10,000.00	9,034.10	
IRISH 0.2 10/18/30	80,000.00	66,003.20	
IRISH 0.35 10/18/32	20,000.00	15,853.60	
IRISH 0.9 05/15/28	80,000.00	73,061.60	
IRISH 1 05/15/26	90,000.00	85,459.50	

IRISH 1.1 05/15/29	50,000.00	45,287.50	
IRISH 1.3 05/15/33	20,000.00	17,075.20	
IRISH 1.35 03/18/31	60,000.00	53,543.40	
IRISH 1.5 05/15/50	70,000.00	46,497.50	
IRISH 1.7 05/15/37	60,000.00	49,369.20	
IRISH 2.4 05/15/30	100,000.00	96,887.00	
IRISH 3 10/18/43	20,000.00	18,952.80	
IRISH 5.4 03/13/25	50,000.00	51,548.00	
IRISH GOVT 0.55 04/22/41	100,000.00	62,579.00	
NETHER 0 01/15/26	100,000.00	93,230.00	
NETHER 0 01/15/27	180,000.00	163,600.20	
NETHER 0 01/15/29	40,000.00	34,439.60	
NETHER 0 01/15/38	70,000.00	45,539.20	
NETHER 0 01/15/52	60,000.00	26,802.00	
NETHER 0 07/15/30	120,000.00	99,206.40	
NETHER 0.25 07/15/25	140,000.00	132,910.40	
NETHER 0.25 07/15/29	150,000.00	129,466.50	
NETHER 0.5 01/15/40	310,000.00	210,490.00	
NETHER 0.5 07/15/26	100,000.00	93,411.00	
NETHER 0.5 07/15/32	100,000.00	81,735.00	
NETHER 0.75 07/15/27	60,000.00	55,432.20	
NETHER 0.75 07/15/28	150,000.00	136,021.50	
NETHER 2 01/15/54	70,000.00	56,669.90	
NETHER 2.5 01/15/33	140,000.00	135,679.60	
NETHER 2.5 07/15/33	30,000.00	29,043.00	
NETHER 2.75 01/15/47	80,000.00	76,983.20	
NETHER 3.75 01/15/42	30,000.00	32,998.50	
NETHER 4 01/15/37	110,000.00	121,777.70	
OBL 0 04/10/26	160,000.00	148,788.80	
OBL 0 04/11/25	360,000.00	342,669.60	
OBL 0 04/16/27	240,000.00	218,179.20	
OBL 0 10/09/26	220,000.00	202,252.60	
OBL 0 10/10/25	100,000.00	94,018.00	
OBL 0 10/10/25	110,000.00	103,548.50	
OBL 1.3 10/15/27	90,000.00	85,394.70	
OBL 1.3 10/15/27	70,000.00	66,516.80	
OBL 2.2 04/13/28	160,000.00	157,107.20	
RAGB 0 02/20/30	70,000.00	57,617.70	
RAGB 0 02/20/31	100,000.00	79,710.00	
RAGB 0 04/20/25	90,000.00	85,490.10	
RAGB 0 10/20/28	80,000.00	68,677.60	
RAGB 0 10/20/40	190,000.00	108,389.30	
RAGB 0.25 10/20/36	100,000.00	67,859.00	
RAGB 0.5 02/20/29	110,000.00	96,285.20	

RAGB 0.5 04/20/27	40,000.00	36,584.80	
RAGB 0.7 04/20/71	70,000.00	28,701.40	
RAGB 0.75 02/20/28	80,000.00	72,545.60	
RAGB 0.75 10/20/26	150,000.00	140,026.50	
RAGB 0.9 02/20/32	100,000.00	83,660.00	
RAGB 1.5 11/02/86	20,000.00	10,972.80	
RAGB 1.85 05/23/49	80,000.00	59,708.80	
RAGB 2.9 02/20/33	40,000.00	39,101.60	
RAGB 3.15 06/20/44	50,000.00	48,589.00	
RAGB 3.8 01/26/62	20,000.00	21,875.80	
RAGB 4.15 03/15/37	90,000.00	97,744.50	
RAGB 4.85 03/15/26	150,000.00	156,078.00	
RAGB 6.25 07/15/27	80,000.00	89,172.80	
RFGB 0 09/15/24	60,000.00	57,952.20	
RFGB 0 09/15/26	100,000.00	91,393.00	
RFGB 0 09/15/30	50,000.00	40,567.00	
RFGB 0.125 04/15/36	40,000.00	27,040.40	
RFGB 0.125 04/15/52	60,000.00	25,977.00	
RFGB 0.125 09/15/31	40,000.00	31,760.80	
RFGB 0.25 09/15/40	30,000.00	18,105.00	
RFGB 0.5 04/15/26	70,000.00	65,695.00	
RFGB 0.5 04/15/43	30,000.00	17,897.70	
RFGB 0.5 09/15/28	60,000.00	53,173.20	
RFGB 0.5 09/15/29	50,000.00	43,239.50	
RFGB 0.75 04/15/31	60,000.00	50,811.00	
RFGB 1.125 04/15/34	100,000.00	81,759.00	
RFGB 1.375 04/15/47	10,000.00	6,938.40	
RFGB 1.5 09/15/32	20,000.00	17,516.60	
RFGB 2.625 07/04/42	10,000.00	9,055.60	
SPGB 0 01/31/25	70,000.00	66,770.90	
SPGB 0 01/31/26	300,000.00	277,290.00	
SPGB 0 01/31/27	210,000.00	188,124.30	
SPGB 0 05/31/25	210,000.00	198,105.60	
SPGB 0.1 04/30/31	100,000.00	78,083.00	
SPGB 0.5 04/30/30	140,000.00	116,652.20	
SPGB 0.5 10/31/31	200,000.00	158,790.00	
SPGB 0.6 10/31/29	100,000.00	85,138.00	
SPGB 0.7 04/30/32	60,000.00	47,752.80	
SPGB 0.8 07/30/27	340,000.00	309,770.60	
SPGB 0.8 07/30/29	10,000.00	8,664.50	
SPGB 0.85 07/30/37	190,000.00	129,454.60	
SPGB 1 07/30/42	300,000.00	182,751.00	
SPGB 1 10/31/50	40,000.00	20,106.80	
SPGB 1.2 10/31/40	290,000.00	191,153.50	



SPGB 1.25 10/31/30	180,000.00	155,950.20	
SPGB 1.4 04/30/28	190,000.00	174,976.70	
SPGB 1.4 07/30/28	210,000.00	192,517.50	
SPGB 1.45 04/30/29	320,000.00	289,945.60	
SPGB 1.45 10/31/27	180,000.00	167,497.20	
SPGB 1.45 10/31/71	70,000.00	31,385.90	
SPGB 1.5 04/30/27	190,000.00	178,607.60	
SPGB 1.6 04/30/25	200,000.00	194,228.00	
SPGB 1.85 07/30/35	20,000.00	16,466.80	
SPGB 1.9 10/31/52	20,000.00	12,485.00	
SPGB 1.95 04/30/26	180,000.00	173,851.20	
SPGB 1.95 07/30/30	210,000.00	191,961.00	
SPGB 2.35 07/30/33	100,000.00	89,843.00	
SPGB 2.55 10/31/32	110,000.00	101,711.50	
SPGB 2.75 10/31/24	80,000.00	79,264.80	
SPGB 2.8 05/31/26	170,000.00	167,570.70	
SPGB 3.15 04/30/33	250,000.00	241,337.50	
SPGB 3.45 07/30/43	50,000.00	45,888.00	
SPGB 3.45 07/30/66	130,000.00	110,960.20	
SPGB 3.55 10/31/33	20,000.00	19,860.60	
SPGB 3.9 07/30/39	350,000.00	346,920.00	
SPGB 4.2 01/31/37	200,000.00	208,216.00	
SPGB 4.65 07/30/25	140,000.00	143,147.20	
SPGB 4.7 07/30/41	100,000.00	109,139.00	
SPGB 5.15 10/31/44	40,000.00	46,355.20	
SPGB 5.75 07/30/32	70,000.00	81,999.40	
SPGB 5.9 07/30/26	60,000.00	64,150.20	
SPGB 6 01/31/29	210,000.00	237,640.20	
ユーロ小計	44,000,000.00	39,541,977.40 (6,227,070,601)	
国債証券合計		18,922,834,265 (18,922,834,265)	
合計		18,922,834,265 (18,922,834,265)	

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

通貨	銘柄数		組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券	193銘柄	47.7%	48.4%
カナダ・ドル	国債証券	30銘柄	2.0%	2.0%
オーストラリア・ドル	国債証券	22銘柄	1.5%	1.5%
シンガポール・ドル	国債証券	13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	49銘柄	4.9%	5.0%
イスラエル・シケル	国債証券	11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	7銘柄	0.2%	0.2%
メキシコ・ペソ	国債証券	13銘柄	1.0%	1.0%
オフショア・人民元	国債証券	22銘柄	6.5%	6.6%
ポーランド・ズロチ	国債証券	9銘柄	0.5%	0.5%
ユーロ	国債証券	299銘柄	32.5%	32.9%

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2022年9月12日現在)	(2023年9月11日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	216,174,427	217,197,619
金銭信託	51,618,064	21,927,226
コール・ローン	1,450,811,286	928,249,419
国債証券	156,284,273,534	165,129,161,640
派生商品評価勘定	135,775	-
未収利息	895,513,359	1,038,102,290
前払費用	52,019,452	88,967,311
流動資産合計	158,950,545,897	167,423,605,505
資産合計	158,950,545,897	167,423,605,505
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	551,738	-
未払金	804,434,374	-
未払解約金	235,539,148	12,794,196
その他未払費用	2,737	7,990
流動負債合計	1,040,527,997	12,802,186
負債合計	1,040,527,997	12,802,186
純資産の部		
元本等		
元本	76,795,410,154	79,394,261,585
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	81,114,607,746	88,016,541,734
元本等合計	157,910,017,900	167,410,803,319
純資産合計	157,910,017,900	167,410,803,319
負債純資産合計	158,950,545,897	167,423,605,505

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年9月13日 至 2023年9月11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>

（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9月12日現在）	（2023年9月11日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	76,795,410,154口	79,394,261,585口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.0562円 （1万口当たりの純資産額20,562円）	1口当たり純資産額 2.1086円 （1万口当たりの純資産額21,086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9月13日 至 2023年9月11日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p>

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

### 金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年9月11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（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>

	(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9月12日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	419,826,935	-	419,385,707	441,228
	カナダ・ドル	19,096,753	-	19,096,996	243
	シンガポール・ドル	9,090,504	-	9,085,355	5,149
	イギリス・ポンド	40,962,831	-	41,031,426	68,595
	デンマーク・クローネ	3,622,456	-	3,620,897	1,559
	オフショア・人民元	43,012,952	-	43,078,842	65,890
	ユーロ	277,328,813	-	277,225,882	102,931
	小計	812,941,244	-	812,525,105	416,139
	売建				
	デンマーク・クローネ	2,356	-	2,356	-
	ユーロ	1,229,058	-	1,228,882	176
	小計	1,231,414	-	1,231,238	176
	合 計	814,172,658	-	813,756,343	415,963

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

(2023年9月11日現在)

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9月13日 至 2023年9月11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9月12日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	81,240,238,352円
同期中における追加設定元本額	11,527,343,152円
同期中における一部解約元本額	15,972,171,350円
2022年9月12日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	25,304,562,579円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	828,158,382円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,156,635,138円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,175,001,572円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	152,526,311円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	6,250,590円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	28,036,019円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	92,655,686円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	248,930,241円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	175,779,350円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	284,649,148円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	23,205,142円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	48,841,238円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	71,389,406円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	49,801,190円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	21,503,378円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	77,033,842円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	57,841,285円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	150,738,817円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	45,415,312円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	22,253,366円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	158,279,290円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	573,738,813円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	31,891,251円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	90,183,578円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	58,720,361円

三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,996,394円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	392,532,958円
三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド	16,444,846円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	3,751,614,393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>	33,601,811円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	6,132,655,891円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	4,104,311,686円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	9,462,762,482円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	30,929,407円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	79,724,138円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	658,062,897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>	111,106,124円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	965,401,491円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,298,450,320円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,386,224,062円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	4,291,532,671円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	604,716円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	7,287,566,777円
三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	314,944,759円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	128,907,845円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	70,531,533円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	31,256,873円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,647,293円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	84,871,500円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	380,180,554円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	90,192,358円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	38,868,189円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,501,058円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	925,852,704円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	568,480,944円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	801,852,282円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	471,632,336円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	292,927,346円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	127,771,330円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	98,401,799円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	126,093,242円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	284,951,860円
合 計	76,795,410,154円

(2023年9月11日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	76,795,410,154円
同期中における追加設定元本額	13,399,654,234円
同期中における一部解約元本額	10,800,802,803円

2023年9月11日現在の元本の内訳

三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	26,603,451,045円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	930,561,373円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,323,254,511円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,415,352,860円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	164,009,819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)	5,977,634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)	25,661,980円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	96,927,254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)	286,725,074円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	210,028,401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)	340,690,759円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	22,249,143円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	166,128,425円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	180,392,210円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	100,600,584円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	34,074,328円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	339,520,384円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	217,974,152円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	605,311,705円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	191,603,396円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	93,190,694円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	208,489,850円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	894,110,043円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	38,751,866円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	126,408,326円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	90,751,827円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	4,358,624円
日興F W S・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	1,219,374,866円
三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド	234,491,533円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	26,867円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	31,324円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	39,141円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	47,947円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	47,947円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	475,572円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	4,199,196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)	17,467,272円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	7,928,172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)	4,481,444円
S M A M・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	4,735,092,348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>	24,742,199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>	4,765,081,202円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用>	3,776,414,227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>	8,946,687,136円
S M A M・バランスファンドV L 3 0<適格機関投資家限定>	29,825,111円
S M A M・バランスファンドV L 5 0<適格機関投資家限定>	70,919,769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>	650,211,181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>	105,409,785円



SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	891,341,019円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,260,343,854円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,251,043,047円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	3,841,934,104円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	604,716円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	6,597,388,341円
三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	317,910,827円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	110,161,119円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	61,534,170円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	29,749,375円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,741,981円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	70,316,869円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	350,309,527円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	76,242,287円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	37,643,421円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,511,845円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	820,004,466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>	489,884,162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>	668,807,457円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	284,791,331円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	229,812,549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>	119,206,614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>	57,520,352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>	91,943,891円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	1,335,263,034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>	73,700,721円
合計	79,394,261,585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 05/31/25	4,400,000.00	4,051,916.00	
		T 0.25 06/30/25	2,900,000.00	2,662,780.00	
		T 0.25 07/31/25	300,000.00	274,509.00	
		T 0.25 09/30/25	2,000,000.00	1,819,520.00	
		T 0.25 10/31/25	1,000,000.00	906,500.00	
		T 0.375 04/30/25	3,000,000.00	2,778,210.00	
		T 0.375 07/31/27	2,500,000.00	2,133,050.00	
		T 0.375 09/15/24	300,000.00	285,258.00	
		T 0.375 09/30/27	4,800,000.00	4,070,976.00	

T 0.375 11/30/25	2,000,000.00	1,812,260.00	
T 0.375 12/31/25	3,000,000.00	2,713,110.00	
T 0.5 03/31/25	1,600,000.00	1,489,584.00	
T 0.5 04/30/27	1,200,000.00	1,038,324.00	
T 0.5 05/31/27	2,500,000.00	2,156,625.00	
T 0.5 06/30/27	4,000,000.00	3,441,240.00	
T 0.5 10/31/27	1,000,000.00	850,190.00	
T 0.625 03/31/27	2,400,000.00	2,092,584.00	
T 0.625 05/15/30	5,000,000.00	3,931,600.00	
T 0.625 07/31/26	800,000.00	713,312.00	
T 0.625 08/15/30	6,000,000.00	4,684,200.00	
T 0.625 10/15/24	4,400,000.00	4,180,396.00	
T 0.625 11/30/27	3,400,000.00	2,898,364.00	
T 0.625 12/31/27	7,200,000.00	6,122,232.00	
T 0.75 01/31/28	5,900,000.00	5,031,815.00	
T 0.75 04/30/26	1,500,000.00	1,353,210.00	
T 0.75 05/31/26	2,000,000.00	1,799,140.00	
T 0.75 08/31/26	1,500,000.00	1,338,795.00	
T 0.75 11/15/24	5,200,000.00	4,929,288.00	
T 0.875 06/30/26	2,000,000.00	1,802,960.00	
T 0.875 11/15/30	7,000,000.00	5,547,710.00	
T 1 07/31/28	2,900,000.00	2,465,319.00	
T 1 12/15/24	4,500,000.00	4,265,415.00	
T 1.125 01/15/25	2,000,000.00	1,893,540.00	
T 1.125 02/15/31	5,700,000.00	4,582,230.00	
T 1.125 02/28/25	1,500,000.00	1,414,245.00	
T 1.125 02/28/27	2,000,000.00	1,781,400.00	
T 1.125 05/15/40	3,800,000.00	2,309,906.00	
T 1.125 08/15/40	3,100,000.00	1,867,843.00	
T 1.125 08/31/28	3,500,000.00	2,987,705.00	
T 1.125 10/31/26	4,400,000.00	3,953,092.00	
T 1.25 05/15/50	5,100,000.00	2,601,000.00	
T 1.25 05/31/28	3,000,000.00	2,595,210.00	
T 1.25 06/30/28	3,000,000.00	2,589,000.00	
T 1.25 08/15/31	5,200,000.00	4,152,876.00	
T 1.25 09/30/28	3,000,000.00	2,570,970.00	
T 1.25 11/30/26	4,200,000.00	3,780,126.00	
T 1.25 12/31/26	2,300,000.00	2,066,849.00	
T 1.375 01/31/25	1,900,000.00	1,802,359.00	
T 1.375 08/15/50	4,500,000.00	2,372,130.00	
T 1.375 08/31/26	600,000.00	545,658.00	
T 1.375 10/31/28	3,000,000.00	2,581,980.00	
T 1.375 11/15/31	4,900,000.00	3,926,664.00	
T 1.375 11/15/40	3,500,000.00	2,193,555.00	

T 1.375 12/31/28	2,500,000.00	2,145,100.00	
T 1.5 01/31/27	4,400,000.00	3,975,268.00	
T 1.5 02/15/25	3,000,000.00	2,846,760.00	
T 1.5 02/15/30	2,100,000.00	1,766,289.00	
T 1.5 09/30/24	1,600,000.00	1,536,688.00	
T 1.5 10/31/24	5,500,000.00	5,267,075.00	
T 1.5 11/30/24	800,000.00	764,088.00	
T 1.5 11/30/28	2,300,000.00	1,989,040.00	
T 1.625 02/15/26	2,900,000.00	2,689,518.00	
T 1.625 05/15/26	11,450,000.00	10,561,709.00	
T 1.625 05/15/31	5,500,000.00	4,557,685.00	
T 1.625 08/15/29	3,750,000.00	3,223,087.50	
T 1.625 09/30/26	3,900,000.00	3,570,606.00	
T 1.625 11/15/50	3,200,000.00	1,806,240.00	
T 1.625 11/30/26	200,000.00	182,194.00	
T 1.75 01/31/29	4,300,000.00	3,754,588.00	
T 1.75 03/15/25	1,500,000.00	1,425,660.00	
T 1.75 08/15/41	4,400,000.00	2,900,040.00	
T 1.75 11/15/29	1,300,000.00	1,121,497.00	
T 1.75 12/31/24	4,000,000.00	3,822,400.00	
T 1.75 12/31/26	2,500,000.00	2,283,100.00	
T 1.875 02/15/32	5,300,000.00	4,403,929.00	
T 1.875 02/15/41	3,300,000.00	2,249,148.00	
T 1.875 02/15/51	5,800,000.00	3,492,412.00	
T 1.875 02/28/27	3,400,000.00	3,106,750.00	
T 1.875 02/28/29	2,800,000.00	2,457,924.00	
T 1.875 08/31/24	300,000.00	289,980.00	
T 1.875 11/15/51	3,300,000.00	1,978,812.00	
T 2 02/15/25	2,500,000.00	2,389,575.00	
T 2 02/15/50	2,800,000.00	1,752,604.00	
T 2 08/15/25	3,300,000.00	3,119,325.00	
T 2 08/15/51	2,900,000.00	1,797,536.00	
T 2 11/15/26	1,000,000.00	922,850.00	
T 2 11/15/41	3,800,000.00	2,609,080.00	
T 2.125 05/15/25	600,000.00	571,392.00	
T 2.125 09/30/24	4,000,000.00	3,867,200.00	
T 2.125 11/30/24	2,600,000.00	2,501,668.00	
T 2.25 02/15/27	4,400,000.00	4,075,500.00	
T 2.25 02/15/52	1,700,000.00	1,120,130.00	
T 2.25 03/31/26	8,200,000.00	7,710,870.00	
T 2.25 05/15/41	3,000,000.00	2,170,770.00	
T 2.25 08/15/27	4,200,000.00	3,859,128.00	
T 2.25 08/15/46	2,450,000.00	1,654,509.50	
T 2.25 08/15/49	3,500,000.00	2,329,530.00	

T 2.25 10/31/24	800,000.00	772,664.00	
T 2.25 11/15/24	5,100,000.00	4,919,970.00	
T 2.25 11/15/25	4,000,000.00	3,782,160.00	
T 2.25 11/15/27	4,400,000.00	4,025,208.00	
T 2.25 12/31/24	3,900,000.00	3,751,215.00	
T 2.375 02/15/42	2,800,000.00	2,043,776.00	
T 2.375 03/31/29	5,000,000.00	4,501,450.00	
T 2.375 05/15/27	3,000,000.00	2,779,200.00	
T 2.375 05/15/29	2,400,000.00	2,158,200.00	
T 2.375 05/15/51	3,900,000.00	2,648,490.00	
T 2.375 11/15/49	1,900,000.00	1,299,752.00	
T 2.5 01/31/25	3,400,000.00	3,275,866.00	
T 2.5 02/15/45	1,400,000.00	1,008,518.00	
T 2.5 02/15/46	1,000,000.00	713,160.00	
T 2.5 02/28/26	2,100,000.00	1,988,763.00	
T 2.5 03/31/27	3,000,000.00	2,799,240.00	
T 2.5 05/15/46	1,600,000.00	1,139,360.00	
T 2.625 01/31/26	2,200,000.00	2,091,364.00	
T 2.625 02/15/29	1,800,000.00	1,645,506.00	
T 2.625 03/31/25	1,000,000.00	962,160.00	
T 2.625 04/15/25	4,500,000.00	4,327,470.00	
T 2.625 05/31/27	4,800,000.00	4,484,400.00	
T 2.625 07/31/29	1,100,000.00	999,680.00	
T 2.625 12/31/25	1,400,000.00	1,332,618.00	
T 2.75 02/15/28	5,300,000.00	4,935,784.00	
T 2.75 02/28/25	2,000,000.00	1,930,880.00	
T 2.75 04/30/27	2,700,000.00	2,536,920.00	
T 2.75 05/15/25	3,000,000.00	2,886,780.00	
T 2.75 05/31/29	1,400,000.00	1,283,422.00	
T 2.75 06/30/25	900,000.00	864,612.00	
T 2.75 08/15/32	4,200,000.00	3,724,686.00	
T 2.75 08/15/42	2,000,000.00	1,544,200.00	
T 2.75 08/15/47	1,800,000.00	1,337,688.00	
T 2.75 08/31/25	3,400,000.00	3,258,016.00	
T 2.75 11/15/42	300,000.00	230,976.00	
T 2.75 11/15/47	1,500,000.00	1,113,390.00	
T 2.875 04/30/25	400,000.00	385,880.00	
T 2.875 04/30/29	3,500,000.00	3,233,160.00	
T 2.875 05/15/28	3,500,000.00	3,269,350.00	
T 2.875 05/15/32	5,700,000.00	5,119,968.00	
T 2.875 05/15/43	1,200,000.00	938,388.00	
T 2.875 05/15/49	1,400,000.00	1,063,636.00	
T 2.875 05/15/52	3,200,000.00	2,427,360.00	
T 2.875 05/31/25	3,100,000.00	2,986,881.00	

T 2.875 06/15/25	2,000,000.00	1,926,240.00	
T 2.875 08/15/28	4,500,000.00	4,191,120.00	
T 2.875 08/15/45	800,000.00	614,248.00	
T 2.875 11/15/46	900,000.00	686,736.00	
T 2.875 11/30/25	2,500,000.00	2,395,200.00	
T 3 02/15/47	2,500,000.00	1,949,950.00	
T 3 02/15/48	2,400,000.00	1,868,088.00	
T 3 02/15/49	3,300,000.00	2,567,466.00	
T 3 05/15/42	800,000.00	644,656.00	
T 3 05/15/45	900,000.00	707,796.00	
T 3 05/15/47	1,800,000.00	1,403,082.00	
T 3 07/15/25	2,000,000.00	1,928,780.00	
T 3 08/15/48	1,300,000.00	1,011,153.00	
T 3 08/15/52	3,000,000.00	2,337,300.00	
T 3 09/30/25	1,000,000.00	962,120.00	
T 3 10/31/25	2,600,000.00	2,499,146.00	
T 3 11/15/44	1,000,000.00	789,920.00	
T 3 11/15/45	800,000.00	627,312.00	
T 3.125 02/15/42	1,000,000.00	825,330.00	
T 3.125 02/15/43	2,300,000.00	1,876,593.00	
T 3.125 05/15/48	2,400,000.00	1,911,360.00	
T 3.125 08/15/25	3,000,000.00	2,896,860.00	
T 3.125 08/15/44	1,300,000.00	1,050,153.00	
T 3.125 11/15/28	2,900,000.00	2,726,435.00	
T 3.125 11/15/41	1,000,000.00	828,940.00	
T 3.25 05/15/42	2,200,000.00	1,843,820.00	
T 3.25 06/30/29	3,000,000.00	2,823,390.00	
T 3.375 05/15/33	5,500,000.00	5,116,265.00	
T 3.375 05/15/44	500,000.00	421,150.00	
T 3.375 08/15/42	3,000,000.00	2,556,480.00	
T 3.375 11/15/48	3,100,000.00	2,583,168.00	
T 3.5 01/31/28	1,000,000.00	961,360.00	
T 3.5 01/31/30	2,500,000.00	2,377,925.00	
T 3.5 02/15/33	6,100,000.00	5,737,782.00	
T 3.5 02/15/39	200,000.00	181,210.00	
T 3.5 04/30/30	2,500,000.00	2,376,350.00	
T 3.625 02/15/44	300,000.00	262,896.00	
T 3.625 02/15/53	1,700,000.00	1,498,244.00	
T 3.625 03/31/28	3,000,000.00	2,898,150.00	
T 3.625 03/31/30	1,200,000.00	1,149,228.00	
T 3.625 05/15/26	2,500,000.00	2,430,175.00	
T 3.625 05/15/53	2,100,000.00	1,852,263.00	
T 3.625 05/31/28	2,000,000.00	1,932,500.00	
T 3.625 08/15/43	1,000,000.00	878,430.00	

T 3.75 04/15/26	1,300,000.00	1,267,955.00	
T 3.75 05/31/30	3,000,000.00	2,893,230.00	
T 3.75 06/30/30	4,400,000.00	4,243,228.00	
T 3.75 08/15/41	1,100,000.00	1,001,594.00	
T 3.75 11/15/43	700,000.00	625,702.00	
T 3.875 01/15/26	5,300,000.00	5,186,103.00	
T 3.875 02/15/43	2,600,000.00	2,376,140.00	
T 3.875 04/30/25	1,000,000.00	980,250.00	
T 3.875 05/15/43	1,500,000.00	1,369,920.00	
T 3.875 08/15/33	2,500,000.00	2,423,225.00	
T 3.875 08/15/40	500,000.00	467,020.00	
T 3.875 09/30/29	2,300,000.00	2,235,830.00	
T 3.875 12/31/27	4,400,000.00	4,294,972.00	
T 3.875 12/31/29	1,500,000.00	1,457,685.00	
T 4 02/15/26	2,000,000.00	1,962,500.00	
T 4 02/28/30	1,500,000.00	1,468,125.00	
T 4 02/29/28	5,000,000.00	4,907,800.00	
T 4 06/30/28	3,000,000.00	2,944,680.00	
T 4 10/31/29	1,600,000.00	1,566,112.00	
T 4 11/15/42	2,000,000.00	1,864,320.00	
T 4 11/15/52	2,600,000.00	2,454,842.00	
T 4.125 01/31/25	3,500,000.00	3,446,940.00	
T 4.125 06/15/26	2,000,000.00	1,970,000.00	
T 4.125 07/31/28	1,000,000.00	987,030.00	
T 4.125 08/15/53	1,000,000.00	965,460.00	
T 4.125 10/31/27	3,500,000.00	3,448,585.00	
T 4.125 11/15/32	5,600,000.00	5,531,960.00	
T 4.25 05/15/39	100,000.00	98,800.00	
T 4.25 10/15/25	2,000,000.00	1,972,720.00	
T 4.25 11/15/40	600,000.00	587,832.00	
T 4.25 12/31/24	1,500,000.00	1,480,005.00	
T 4.375 05/15/40	900,000.00	896,724.00	
T 4.375 05/15/41	300,000.00	297,273.00	
T 4.375 08/15/26	4,000,000.00	3,965,760.00	
T 4.375 11/15/39	300,000.00	299,634.00	
T 4.5 05/15/38	2,000,000.00	2,043,200.00	
T 4.5 07/15/26	3,900,000.00	3,878,355.00	
T 4.5 08/15/39	300,000.00	304,440.00	
T 4.5 11/15/25	3,800,000.00	3,767,320.00	
T 4.625 02/15/40	1,000,000.00	1,028,260.00	
T 4.625 02/28/25	3,800,000.00	3,768,308.00	
T 4.625 03/15/26	2,500,000.00	2,490,025.00	
T 4.75 02/15/41	900,000.00	935,433.00	
T 5.25 11/15/28	500,000.00	518,495.00	

	T 5.375 02/15/31	320,000.00	341,686.40	
	T 6 02/15/26	1,000,000.00	1,026,010.00	
	T 6.125 11/15/27	1,000,000.00	1,061,480.00	
	アメリカ・ドル小計	620,170,000.00	543,559,890.40 (79,886,997,092)	
カナダ・ドル	CAN 0.5 09/01/25	2,700,000.00	2,492,154.00	
	CAN 1 06/01/27	1,100,000.00	986,172.00	
	CAN 1.25 03/01/27	400,000.00	362,444.00	
	CAN 1.25 06/01/30	1,000,000.00	851,770.00	
	CAN 1.5 04/01/25	700,000.00	665,301.00	
	CAN 1.5 06/01/26	3,000,000.00	2,787,300.00	
	CAN 1.5 12/01/31	2,300,000.00	1,941,407.00	
	CAN 1.75 12/01/53	1,000,000.00	678,480.00	
	CAN 2 06/01/28	700,000.00	643,804.00	
	CAN 2 06/01/32	2,000,000.00	1,747,260.00	
	CAN 2.25 06/01/25	500,000.00	480,200.00	
	CAN 2.25 06/01/29	1,100,000.00	1,015,124.00	
	CAN 2.25 12/01/29	1,000,000.00	917,450.00	
	CAN 2.5 12/01/32	2,500,000.00	2,269,400.00	
	CAN 2.75 06/01/33	1,400,000.00	1,295,602.00	
	CAN 2.75 09/01/27	2,300,000.00	2,187,737.00	
	CAN 2.75 12/01/48	1,300,000.00	1,133,262.00	
	CAN 2.75 12/01/55	200,000.00	171,294.00	
	CAN 3 04/01/26	200,000.00	193,270.00	
	CAN 3 10/01/25	900,000.00	871,956.00	
	CAN 3.5 08/01/25	1,000,000.00	979,190.00	
	CAN 3.5 12/01/45	1,200,000.00	1,186,824.00	
	CAN 4 06/01/41	1,300,000.00	1,363,440.00	
	CAN 4.5 11/01/25	1,800,000.00	1,797,084.00	
	CAN 5 06/01/37	400,000.00	456,292.00	
	CAN 5.75 06/01/29	250,000.00	274,882.50	
CAN 5.75 06/01/33	400,000.00	466,616.00		
CANADA 2.75 12/01/64	700,000.00	587,153.00		
	カナダ・ドル小計	33,350,000.00	30,802,868.50 (3,321,781,339)	
オーストラリア・ドル	ACGB 0.25 11/21/25	1,300,000.00	1,203,371.00	
	ACGB 0.5 09/21/26	100,000.00	90,698.00	
	ACGB 1.25 05/21/32	400,000.00	318,564.00	
	ACGB 1.5 06/21/31	4,400,000.00	3,670,172.00	
	ACGB 1.75 06/21/51	500,000.00	284,340.00	
	ACGB 1.75 11/21/32	1,400,000.00	1,152,648.00	
	ACGB 2.25 05/21/28	1,300,000.00	1,214,174.00	
	ACGB 2.5 05/21/30	2,100,000.00	1,924,965.00	
	ACGB 2.75 06/21/35	800,000.00	697,072.00	

	ACGB 2.75 11/21/27	3,300,000.00	3,168,363.00	
	ACGB 2.75 11/21/28	200,000.00	189,980.00	
	ACGB 2.75 11/21/29	1,800,000.00	1,687,734.00	
	ACGB 3 03/21/47	1,200,000.00	945,120.00	
	ACGB 3 11/21/33	1,000,000.00	910,460.00	
	ACGB 3.25 04/21/25	1,300,000.00	1,286,987.00	
	ACGB 3.25 04/21/29	800,000.00	775,736.00	
	ACGB 3.25 06/21/39	2,000,000.00	1,754,220.00	
	ACGB 3.75 04/21/37	900,000.00	855,495.00	
	ACGB 4.25 04/21/26	2,150,000.00	2,174,768.00	
	ACGB 4.5 04/21/33	1,500,000.00	1,551,075.00	
	オーストラリア・ドル小計	28,450,000.00	25,855,942.00 (2,430,458,548)	
シンガポール・ドル	SIGB 0.5 11/01/25	200,000.00	187,880.00	
	SIGB 1.25 11/01/26	600,000.00	562,920.00	
	SIGB 1.625 07/01/31	1,000,000.00	891,300.00	
	SIGB 2.25 08/01/36	1,000,000.00	903,000.00	
	SIGB 2.625 05/01/28	800,000.00	782,240.00	
	SIGB 2.75 03/01/46	800,000.00	758,400.00	
	SIGB 2.75 04/01/42	700,000.00	665,623.00	
	SIGB 2.875 09/01/30	200,000.00	195,900.00	
	SIGB 3 09/01/24	500,000.00	497,000.00	
	SIGB 3.375 09/01/33	300,000.00	304,194.00	
	SIGB 3.5 03/01/27	1,100,000.00	1,108,580.00	
	シンガポール・ドル小計	7,200,000.00	6,857,037.00 (738,982,876)	
ニュージーランド・ドル	NZGB 0.5 05/15/26	100,000.00	88,447.00	
	NZGB 1.75 05/15/41	700,000.00	427,420.00	
	NZGB 2 05/15/32	970,000.00	770,568.00	
	NZGB 2.75 04/15/25	550,000.00	527,340.00	
	NZGB 2.75 05/15/51	500,000.00	325,770.00	
	NZGB 3 04/20/29	1,000,000.00	905,820.00	
	NZGB 4.5 04/15/27	1,100,000.00	1,079,463.00	
	NZGB 4.5 05/15/30	170,000.00	165,807.80	
	ニュージーランド・ドル小計	5,090,000.00	4,290,635.80 (372,427,187)	
イギリス・ポンド	UK TSY GILT 1.125 01/31/39	400,000.00	246,420.00	
	UKT 0.125 01/30/26	1,300,000.00	1,170,962.00	
	UKT 0.125 01/31/28	1,300,000.00	1,078,727.00	
	UKT 0.25 01/31/25	700,000.00	657,139.00	
	UKT 0.25 07/31/31	1,300,000.00	947,687.00	
	UKT 0.375 10/22/26	1,200,000.00	1,054,464.00	
	UKT 0.375 10/22/30	1,800,000.00	1,368,702.00	
	UKT 0.5 01/31/29	2,500,000.00	2,030,500.00	



UKT 0.5 10/22/61	900,000.00	260,172.00	
UKT 0.625 06/07/25	900,000.00	838,476.00	
UKT 0.625 07/31/35	1,900,000.00	1,228,521.00	
UKT 0.875 07/31/33	800,000.00	575,144.00	
UKT 0.875 10/22/29	500,000.00	408,275.00	
UKT 1 01/31/32	1,500,000.00	1,147,395.00	
UKT 1.125 10/22/73	300,000.00	106,884.00	
UKT 1.25 07/22/27	900,000.00	798,435.00	
UKT 1.25 07/31/51	1,200,000.00	565,968.00	
UKT 1.25 10/22/41	2,100,000.00	1,229,949.00	
UKT 1.5 07/22/26	1,100,000.00	1,010,768.00	
UKT 1.5 07/22/47	2,000,000.00	1,086,440.00	
UKT 1.625 10/22/28	300,000.00	262,758.00	
UKT 1.625 10/22/54	500,000.00	254,450.00	
UKT 1.75 01/22/49	1,250,000.00	708,875.00	
UKT 1.75 09/07/37	100,000.00	70,856.00	
UKT 2 09/07/25	1,100,000.00	1,041,579.00	
UKT 2.5 07/22/65	1,600,000.00	1,003,104.00	
UKT 2.75 09/07/24	900,000.00	880,695.00	
UKT 3.25 01/22/44	1,600,000.00	1,292,800.00	
UKT 3.25 01/31/33	1,900,000.00	1,731,280.00	
UKT 3.5 01/22/45	1,250,000.00	1,042,737.50	
UKT 3.5 07/22/68	1,300,000.00	1,053,988.00	
UKT 3.5 10/22/25	400,000.00	387,708.00	
UKT 3.75 01/29/38	900,000.00	815,544.00	
UKT 3.75 07/22/52	1,200,000.00	1,023,360.00	
UKT 4 01/22/60	1,300,000.00	1,168,245.00	
UKT 4.125 01/29/27	1,700,000.00	1,666,799.00	
UKT 4.25 03/07/36	700,000.00	682,423.00	
UKT 4.25 06/07/32	500,000.00	497,615.00	
UKT 4.25 09/07/39	600,000.00	572,268.00	
UKT 4.25 12/07/27	900,000.00	892,026.00	
UKT 4.25 12/07/40	600,000.00	569,694.00	
UKT 4.25 12/07/46	1,500,000.00	1,397,265.00	
UKT 4.25 12/07/49	900,000.00	836,811.00	
UKT 4.25 12/07/55	1,700,000.00	1,590,384.00	
UKT 4.5 09/07/34	400,000.00	401,108.00	
UKT 4.5 12/07/42	1,050,000.00	1,023,403.50	
UKT 4.75 12/07/30	1,150,000.00	1,180,337.00	
UKT 4.75 12/07/38	1,000,000.00	1,014,040.00	
UKT 5 03/07/25	1,300,000.00	1,301,781.00	
UKT 6 12/07/28	650,000.00	697,053.50	
イギリス・ポンド小計	54,850,000.00	44,872,015.50 (8,235,809,725)	

イスラエル・シュケル	ILGOV 0.4 10/31/24	1,800,000.00	1,718,550.00	
	ILGOV 0.5 04/30/25	3,100,000.00	2,912,853.00	
	ILGOV 1 03/31/30	700,000.00	582,372.00	
	ILGOV 1.5 05/31/37	900,000.00	655,812.00	
	ILGOV 2.25 09/28/28	800,000.00	739,032.00	
	ILGOV 3.75 02/28/29	500,000.00	494,930.00	
	ILGOV 3.75 03/31/47	3,600,000.00	3,313,548.00	
	ILGOV 6.25 10/30/26	2,400,000.00	2,553,456.00	
イスラエル・シュケル小計		13,800,000.00	12,970,553.00 (494,779,903)	
デンマーク・クローネ	DGB 0 11/15/31	500,000.00	400,270.00	
	DGB 0.25 11/15/52	1,800,000.00	890,298.00	
	DGB 0.5 11/15/27	7,800,000.00	7,107,126.00	
	DGB 0.5 11/15/29	5,400,000.00	4,720,302.00	
	DGB 1.75 11/15/25	2,400,000.00	2,334,216.00	
	DGB 2.25 11/15/33	900,000.00	852,651.00	
	DGB 4.5 11/15/39	7,300,000.00	8,781,170.00	
デンマーク・クローネ小計		26,100,000.00	25,086,033.00 (529,817,017)	
ノルウェー・クローネ	NGB 1.375 08/19/30	6,200,000.00	5,239,000.00	
	NGB 1.5 02/19/26	3,000,000.00	2,813,190.00	
	NGB 1.75 02/17/27	200,000.00	184,766.00	
	NGB 1.75 03/13/25	1,200,000.00	1,155,900.00	
	NGB 1.75 09/06/29	5,000,000.00	4,409,500.00	
	NGB 2 04/26/28	5,900,000.00	5,393,426.00	
ノルウェー・クローネ小計		21,500,000.00	19,195,782.00 (264,325,918)	
スウェーデン・クローナ	SGB 0.125 05/12/31	500,000.00	407,510.00	
	SGB 0.75 05/12/28	3,700,000.00	3,349,277.00	
	SGB 0.75 11/12/29	4,200,000.00	3,705,576.00	
	SGB 1 11/12/26	6,200,000.00	5,800,720.00	
	SGB 2.5 05/12/25	5,000,000.00	4,922,300.00	
	SGB 3.5 03/30/39	5,300,000.00	5,662,202.00	
スウェーデン・クローナ小計		24,900,000.00	23,847,585.00 (315,742,025)	
メキシコ・ペソ	MBONO 10 12/05/24	32,000,000.00	31,635,840.00	
	MBONO 5 03/06/25	12,000,000.00	11,112,360.00	
	MBONO 5.5 03/04/27	3,000,000.00	2,612,520.00	
	MBONO 5.75 03/05/26	19,000,000.00	17,153,390.00	
	MBONO 7.5 05/26/33	6,000,000.00	5,241,480.00	
	MBONO 7.5 06/03/27	21,000,000.00	19,511,730.00	
	MBONO 7.75 05/29/31	29,000,000.00	26,140,890.00	
	MBONO 7.75 11/23/34	18,000,000.00	15,843,600.00	
	MBONO 8 11/07/47	9,000,000.00	7,694,370.00	
	MBONO 8.5 05/31/29	23,000,000.00	21,913,480.00	

	MBONO 8.5 11/18/38	40,000,000.00	36,547,200.00	
	メキシコ・ペソ小計	212,000,000.00	195,406,860.00 (1,635,907,151)	
オフショ ア・人民元	CGB 2.18 08/25/25	39,000,000.00	38,958,270.00	
	CGB 2.24 05/25/25	31,000,000.00	30,995,660.00	
	CGB 2.26 02/24/25	18,000,000.00	18,000,180.00	
	CGB 2.3 05/15/26	17,000,000.00	16,991,330.00	
	CGB 2.4 07/15/28	30,000,000.00	29,904,000.00	
	CGB 2.46 02/15/26	29,000,000.00	29,082,360.00	
	CGB 2.47 09/02/24	29,000,000.00	29,106,140.00	
	CGB 2.48 04/15/27	9,000,000.00	9,013,320.00	
	CGB 2.5 07/25/27	16,000,000.00	16,023,840.00	
	CGB 2.52 08/25/33	5,000,000.00	4,957,850.00	
	CGB 2.62 04/15/28	24,000,000.00	24,149,040.00	
	CGB 2.62 06/25/30	17,000,000.00	16,970,250.00	
	CGB 2.62 09/25/29	23,000,000.00	23,002,300.00	
	CGB 2.64 01/15/28	11,500,000.00	11,570,265.00	
	CGB 2.67 05/25/33	5,000,000.00	4,998,550.00	
	CGB 2.69 08/12/26	51,000,000.00	51,536,520.00	
	CGB 2.8 03/24/29	26,000,000.00	26,275,600.00	
	CGB 2.8 03/25/30	5,000,000.00	5,044,200.00	
	CGB 2.8 11/15/32	21,000,000.00	21,113,400.00	
	CGB 2.88 02/25/33	10,900,000.00	11,087,262.00	
CGB 2.91 10/14/28	21,000,000.00	21,385,350.00		
CGB 3.02 05/27/31	43,000,000.00	44,235,820.00		
CGB 3.12 10/25/52	13,000,000.00	13,288,210.00		
CGB 3.19 04/15/53	4,000,000.00	4,176,440.00		
CGB 3.72 04/12/51	38,000,000.00	42,805,480.00		
	オフショア・人民元小計	536,400,000.00	544,671,637.00 (10,882,266,971)	
マレーシ ア・リン ギット	MGS 3.502 05/31/27	5,100,000.00	5,080,212.00	
	MGS 3.582 07/15/32	2,500,000.00	2,448,025.00	
	MGS 3.757 05/22/40	1,400,000.00	1,337,084.00	
	MGS 3.882 03/14/25	1,500,000.00	1,512,270.00	
	MGS 3.9 11/30/26	1,300,000.00	1,314,573.00	
	MGS 3.955 09/15/25	3,200,000.00	3,230,784.00	
	MGS 4.498 04/15/30	4,000,000.00	4,175,560.00	
	MGS 4.504 04/30/29	700,000.00	726,712.00	
	MGS 4.696 10/15/42	600,000.00	641,652.00	
	MGS 4.736 03/15/46	6,700,000.00	7,144,411.00	
	マレーシア・リングギット小計	27,000,000.00	27,611,283.00 (868,289,255)	
ポーラン ド・ズロチ	POLGB 0.25 10/25/26	7,400,000.00	6,419,870.00	
	POLGB 0.75 04/25/25	1,800,000.00	1,690,110.00	

	POLGB 1.25 10/25/30	7,800,000.00	5,943,054.00	
	POLGB 2.25 10/25/24	6,500,000.00	6,317,545.00	
	POLGB 2.75 04/25/28	2,200,000.00	1,994,586.00	
	POLGB 2.75 10/25/29	700,000.00	611,072.00	
	POLGB 6 10/25/33	1,000,000.00	1,037,450.00	
	ポーランド・ズロチ小計	27,400,000.00	24,013,687.00 (818,921,958)	
ユーロ	BGB 0 10/22/27	500,000.00	443,185.00	
	BGB 0 10/22/31	1,500,000.00	1,169,760.00	
	BGB 0.1 06/22/30	700,000.00	576,352.00	
	BGB 0.35 06/22/32	300,000.00	236,202.00	
	BGB 0.4 06/22/40	300,000.00	182,502.00	
	BGB 0.5 10/22/24	1,000,000.00	968,330.00	
	BGB 0.65 06/22/71	400,000.00	150,616.00	
	BGB 0.8 06/22/25	700,000.00	670,950.00	
	BGB 0.8 06/22/27	800,000.00	738,272.00	
	BGB 0.8 06/22/28	1,000,000.00	906,630.00	
	BGB 0.9 06/22/29	900,000.00	803,286.00	
	BGB 1 06/22/26	900,000.00	851,175.00	
	BGB 1 06/22/31	1,300,000.00	1,115,114.00	
	BGB 1.25 04/22/33	1,100,000.00	931,216.00	
	BGB 1.45 06/22/37	1,200,000.00	941,988.00	
	BGB 1.6 06/22/47	650,000.00	445,646.50	
	BGB 1.7 06/22/50	1,100,000.00	743,039.00	
	BGB 1.9 06/22/38	1,000,000.00	819,730.00	
	BGB 2.15 06/22/66	500,000.00	350,350.00	
	BGB 2.25 06/22/57	500,000.00	370,170.00	
	BGB 3 06/22/34	200,000.00	194,612.00	
	BGB 3.75 06/22/45	600,000.00	617,544.00	
	BGB 4 03/28/32	300,000.00	319,698.00	
	BGB 4.25 03/28/41	1,000,000.00	1,094,590.00	
	BGB 4.5 03/28/26	1,100,000.00	1,136,531.00	
	BGB 5 03/28/35	1,000,000.00	1,156,770.00	
	BGB 5.5 03/28/28	1,000,000.00	1,107,320.00	
	BK0 3.1 09/18/25	300,000.00	300,159.00	
	BTPS 0 08/01/26	1,000,000.00	900,890.00	
	BTPS 0 12/15/24	1,300,000.00	1,241,045.00	
	BTPS 0.35 02/01/25	2,400,000.00	2,292,456.00	
	BTPS 0.45 02/15/29	2,400,000.00	2,005,176.00	
	BTPS 0.5 02/01/26	1,000,000.00	928,140.00	
	BTPS 0.85 01/15/27	1,700,000.00	1,551,692.00	
	BTPS 0.9 04/01/31	2,000,000.00	1,596,000.00	
	BTPS 0.95 03/01/37	700,000.00	456,092.00	
	BTPS 0.95 06/01/32	3,500,000.00	2,695,105.00	

BTPS 0.95 08/01/30	700,000.00	573,118.00	
BTPS 0.95 09/15/27	800,000.00	719,168.00	
BTPS 0.95 12/01/31	2,600,000.00	2,036,814.00	
BTPS 1.1 04/01/27	3,000,000.00	2,746,410.00	
BTPS 1.25 12/01/26	800,000.00	742,224.00	
BTPS 1.45 03/01/36	400,000.00	287,504.00	
BTPS 1.45 05/15/25	700,000.00	675,129.00	
BTPS 1.45 11/15/24	1,800,000.00	1,753,416.00	
BTPS 1.5 06/01/25	1,900,000.00	1,831,106.00	
BTPS 1.6 06/01/26	1,200,000.00	1,136,796.00	
BTPS 1.65 12/01/30	1,600,000.00	1,363,824.00	
BTPS 1.7 09/01/51	1,500,000.00	842,010.00	
BTPS 1.85 07/01/25	1,000,000.00	968,780.00	
BTPS 2 02/01/28	2,500,000.00	2,327,250.00	
BTPS 2 12/01/25	1,300,000.00	1,254,682.00	
BTPS 2.05 08/01/27	1,500,000.00	1,412,310.00	
BTPS 2.1 07/15/26	1,000,000.00	958,400.00	
BTPS 2.2 06/01/27	900,000.00	854,496.00	
BTPS 2.25 09/01/36	500,000.00	393,210.00	
BTPS 2.45 09/01/33	600,000.00	514,038.00	
BTPS 2.45 09/01/50	900,000.00	605,187.00	
BTPS 2.5 11/15/25	1,200,000.00	1,171,308.00	
BTPS 2.5 12/01/24	1,300,000.00	1,281,345.00	
BTPS 2.65 12/01/27	400,000.00	383,460.00	
BTPS 2.7 03/01/47	1,550,000.00	1,138,103.00	
BTPS 2.8 03/01/67	700,000.00	468,727.00	
BTPS 2.8 06/15/29	1,000,000.00	945,040.00	
BTPS 2.8 12/01/28	1,600,000.00	1,525,376.00	
BTPS 2.95 09/01/38	1,000,000.00	831,820.00	
BTPS 3 08/01/29	2,600,000.00	2,482,974.00	
BTPS 3.1 03/01/40	500,000.00	415,900.00	
BTPS 3.25 09/01/46	1,600,000.00	1,297,584.00	
BTPS 3.35 03/01/35	850,000.00	771,043.50	
BTPS 3.45 03/01/48	1,000,000.00	831,680.00	
BTPS 3.5 03/01/30	1,000,000.00	976,650.00	
BTPS 3.7 06/15/30	600,000.00	589,632.00	
BTPS 3.75 09/01/24	2,200,000.00	2,198,768.00	
BTPS 3.85 09/01/49	1,500,000.00	1,321,995.00	
BTPS 3.85 12/15/29	1,300,000.00	1,293,838.00	
BTPS 4 02/01/37	2,600,000.00	2,485,990.00	
BTPS 4 04/30/35	700,000.00	676,991.00	
BTPS 4.4 05/01/33	300,000.00	304,290.00	
BTPS 4.5 03/01/26	1,300,000.00	1,325,259.00	
BTPS 4.75 09/01/28	1,800,000.00	1,878,336.00	

BTPS 4.75 09/01/44	1,400,000.00	1,420,272.00	
BTPS 5 03/01/25	1,000,000.00	1,017,960.00	
BTPS 5 08/01/34	1,570,000.00	1,658,155.50	
BTPS 5 08/01/39	1,800,000.00	1,888,092.00	
BTPS 5 09/01/40	1,700,000.00	1,783,402.00	
BTPS 5.75 02/01/33	1,700,000.00	1,903,133.00	
BTPS 6 05/01/31	2,200,000.00	2,489,036.00	
BTPS 6.5 11/01/27	1,700,000.00	1,882,903.00	
BTPS 7.25 11/01/26	400,000.00	441,940.00	
DBR 0 02/15/30	1,500,000.00	1,278,450.00	
DBR 0 02/15/32	3,200,000.00	2,594,080.00	
DBR 0 05/15/35	2,900,000.00	2,134,371.00	
DBR 0 05/15/36	800,000.00	571,384.00	
DBR 0 08/15/29	2,500,000.00	2,156,175.00	
DBR 0 08/15/30	2,300,000.00	1,937,060.00	
DBR 0 08/15/31	600,000.00	492,876.00	
DBR 0 08/15/31	2,300,000.00	1,891,267.00	
DBR 0 08/15/50	3,000,000.00	1,482,660.00	
DBR 0 08/15/50	700,000.00	347,676.00	
DBR 0 11/15/27	1,300,000.00	1,166,906.00	
DBR 0.25 02/15/27	500,000.00	460,280.00	
DBR 0.25 02/15/29	1,800,000.00	1,593,180.00	
DBR 0.25 08/15/28	1,500,000.00	1,341,525.00	
DBR 0.5 02/15/25	2,500,000.00	2,406,450.00	
DBR 0.5 02/15/26	3,200,000.00	3,022,560.00	
DBR 0.5 02/15/28	1,600,000.00	1,461,792.00	
DBR 0.5 08/15/27	2,100,000.00	1,934,499.00	
DBR 1 05/15/38	1,400,000.00	1,108,464.00	
DBR 1 08/15/25	1,900,000.00	1,827,724.00	
DBR 1.25 08/15/48	1,650,000.00	1,225,504.50	
DBR 1.7 08/15/32	2,800,000.00	2,613,492.00	
DBR 1.8 08/15/53	200,000.00	162,720.00	
DBR 1.8 08/15/53	400,000.00	326,108.00	
DBR 2.1 11/15/29	1,400,000.00	1,363,264.00	
DBR 2.3 02/15/33	1,600,000.00	1,564,272.00	
DBR 2.5 07/04/44	1,600,000.00	1,540,896.00	
DBR 2.5 08/15/46	2,700,000.00	2,603,232.00	
DBR 3.25 07/04/42	1,000,000.00	1,070,480.00	
DBR 4 01/04/37	1,300,000.00	1,484,119.00	
DBR 4.25 07/04/39	700,000.00	833,007.00	
DBR 4.75 07/04/28	1,600,000.00	1,756,256.00	
DBR 4.75 07/04/34	600,000.00	718,554.00	
DBR 4.75 07/04/40	1,450,000.00	1,836,048.00	
DBR 5.5 01/04/31	900,000.00	1,076,535.00	

DBR 5.625 01/04/28	1,000,000.00	1,121,460.00	
DBR 6.25 01/04/30	800,000.00	971,568.00	
DBR 6.5 07/04/27	1,000,000.00	1,134,710.00	
FRTR 0 02/25/25	3,000,000.00	2,860,560.00	
FRTR 0 02/25/26	3,800,000.00	3,526,020.00	
FRTR 0 02/25/27	1,100,000.00	993,311.00	
FRTR 0 03/25/25	1,900,000.00	1,807,755.00	
FRTR 0 05/25/32	2,900,000.00	2,233,928.00	
FRTR 0 11/25/29	4,500,000.00	3,760,245.00	
FRTR 0 11/25/30	3,900,000.00	3,157,713.00	
FRTR 0 11/25/31	3,000,000.00	2,351,430.00	
FRTR 0.25 11/25/26	2,900,000.00	2,657,444.00	
FRTR 0.5 05/25/25	1,300,000.00	1,241,227.00	
FRTR 0.5 05/25/26	3,300,000.00	3,082,794.00	
FRTR 0.5 05/25/29	3,000,000.00	2,622,300.00	
FRTR 0.5 05/25/40	1,300,000.00	819,533.00	
FRTR 0.5 05/25/72	100,000.00	34,630.00	
FRTR 0.5 06/25/44	1,200,000.00	680,748.00	
FRTR 0.75 02/25/28	3,200,000.00	2,908,928.00	
FRTR 0.75 05/25/28	3,100,000.00	2,804,167.00	
FRTR 0.75 05/25/52	3,000,000.00	1,523,310.00	
FRTR 0.75 11/25/28	3,100,000.00	2,776,918.00	
FRTR 1 05/25/27	2,200,000.00	2,048,508.00	
FRTR 1 11/25/25	1,500,000.00	1,433,145.00	
FRTR 1.25 05/25/34	1,200,000.00	990,792.00	
FRTR 1.25 05/25/36	3,700,000.00	2,917,598.00	
FRTR 1.25 05/25/38	900,000.00	677,952.00	
FRTR 1.5 05/25/31	3,050,000.00	2,744,786.50	
FRTR 1.5 05/25/50	2,400,000.00	1,571,520.00	
FRTR 1.75 05/25/66	800,000.00	501,872.00	
FRTR 1.75 06/25/39	2,700,000.00	2,173,473.00	
FRTR 1.75 11/25/24	1,300,000.00	1,274,806.00	
FRTR 2 05/25/48	2,000,000.00	1,503,800.00	
FRTR 2 11/25/32	3,500,000.00	3,199,140.00	
FRTR 2.5 05/25/30	3,100,000.00	3,017,323.00	
FRTR 2.5 09/24/26	500,000.00	491,640.00	
FRTR 2.75 02/25/29	300,000.00	296,637.00	
FRTR 2.75 10/25/27	3,850,000.00	3,817,698.50	
FRTR 3 05/25/33	1,500,000.00	1,483,800.00	
FRTR 3.25 05/25/45	900,000.00	865,881.00	
FRTR 3.5 04/25/26	1,800,000.00	1,817,874.00	
FRTR 4 04/25/55	1,370,000.00	1,479,271.20	
FRTR 4 04/25/60	1,400,000.00	1,518,888.00	
FRTR 4 10/25/38	2,000,000.00	2,145,740.00	

FRTR 4.5 04/25/41	2,100,000.00	2,388,834.00	
FRTR 4.75 04/25/35	800,000.00	914,408.00	
FRTR 5.5 04/25/29	1,650,000.00	1,863,411.00	
FRTR 5.75 10/25/32	400,000.00	483,876.00	
FRTR 6 10/25/25	2,100,000.00	2,219,427.00	
IRISH 0 10/18/31	500,000.00	394,915.00	
IRISH 0.9 05/15/28	500,000.00	456,635.00	
IRISH 1 05/15/26	800,000.00	759,640.00	
IRISH 1.1 05/15/29	500,000.00	452,875.00	
IRISH 1.3 05/15/33	800,000.00	683,008.00	
IRISH 1.35 03/18/31	500,000.00	446,195.00	
IRISH 1.5 05/15/50	500,000.00	332,125.00	
IRISH 1.7 05/15/37	300,000.00	246,846.00	
IRISH 2 02/18/45	1,100,000.00	860,057.00	
IRISH 2.4 05/15/30	600,000.00	581,322.00	
IRISH 5.4 03/13/25	800,000.00	824,768.00	
NETHER 0 01/15/27	1,300,000.00	1,181,557.00	
NETHER 0 07/15/30	2,200,000.00	1,818,784.00	
NETHER 0.25 07/15/25	1,300,000.00	1,234,168.00	
NETHER 0.25 07/15/29	1,000,000.00	863,110.00	
NETHER 0.5 01/15/40	1,700,000.00	1,154,300.00	
NETHER 0.5 07/15/26	1,000,000.00	934,110.00	
NETHER 0.5 07/15/32	1,400,000.00	1,144,290.00	
NETHER 0.75 07/15/27	400,000.00	369,548.00	
NETHER 0.75 07/15/28	1,500,000.00	1,360,215.00	
NETHER 2.5 01/15/33	600,000.00	581,484.00	
NETHER 2.75 01/15/47	2,200,000.00	2,117,038.00	
NETHER 3.75 01/15/42	1,300,000.00	1,429,935.00	
NETHER 4 01/15/37	700,000.00	774,949.00	
NETHER 5.5 01/15/28	700,000.00	773,983.00	
OBL 0 04/10/26	2,100,000.00	1,952,853.00	
OBL 0 04/11/25	2,800,000.00	2,665,208.00	
OBL 0 04/16/27	3,200,000.00	2,909,056.00	
OBL 0 10/09/26	1,000,000.00	919,330.00	
OBL 0 10/10/25	2,600,000.00	2,444,468.00	
OBL 0 10/18/24	1,500,000.00	1,446,240.00	
OBL 2.2 04/13/28	600,000.00	589,152.00	
OBL 2.4 10/19/28	700,000.00	693,266.00	
RAGB 0 02/20/30	1,300,000.00	1,070,043.00	
RAGB 0 02/20/31	1,400,000.00	1,115,940.00	
RAGB 0 04/20/25	300,000.00	284,967.00	
RAGB 0.5 02/20/29	550,000.00	481,426.00	
RAGB 0.5 04/20/27	700,000.00	640,234.00	
RAGB 0.75 02/20/28	600,000.00	544,092.00	



RAGB 0.75 03/20/51	900,000.00	489,420.00	
RAGB 0.75 10/20/26	600,000.00	560,106.00	
RAGB 0.85 06/30/20	150,000.00	57,934.50	
RAGB 0.9 02/20/32	700,000.00	585,620.00	
RAGB 1.2 10/20/25	1,000,000.00	961,920.00	
RAGB 1.5 02/20/47	700,000.00	491,708.00	
RAGB 1.5 11/02/86	400,000.00	219,456.00	
RAGB 1.65 10/21/24	500,000.00	490,270.00	
RAGB 2.4 05/23/34	1,000,000.00	928,100.00	
RAGB 3.15 06/20/44	500,000.00	485,890.00	
RAGB 3.8 01/26/62	700,000.00	765,653.00	
RAGB 4.15 03/15/37	300,000.00	325,815.00	
RAGB 4.85 03/15/26	800,000.00	832,416.00	
RAGB 6.25 07/15/27	1,000,000.00	1,114,660.00	
RFGB 0 09/15/26	1,000,000.00	913,930.00	
RFGB 0 09/15/30	400,000.00	324,536.00	
RFGB 0.25 09/15/40	500,000.00	301,750.00	
RFGB 0.5 04/15/26	700,000.00	656,950.00	
RFGB 0.5 09/15/28	300,000.00	265,866.00	
RFGB 0.5 09/15/29	800,000.00	691,832.00	
RFGB 0.75 04/15/31	800,000.00	677,480.00	
RFGB 1.375 04/15/47	500,000.00	346,920.00	
RFGB 2.625 07/04/42	800,000.00	724,448.00	
RFGB 2.75 07/04/28	200,000.00	198,122.00	
RFGB 4 07/04/25	300,000.00	303,948.00	
SPGB 0 01/31/25	500,000.00	476,935.00	
SPGB 0 05/31/25	2,600,000.00	2,452,736.00	
SPGB 0.5 04/30/30	1,600,000.00	1,333,168.00	
SPGB 0.5 10/31/31	1,400,000.00	1,111,530.00	
SPGB 0.7 04/30/32	2,200,000.00	1,750,936.00	
SPGB 0.8 07/30/27	1,700,000.00	1,548,853.00	
SPGB 0.8 07/30/29	700,000.00	606,515.00	
SPGB 0.85 07/30/37	800,000.00	545,072.00	
SPGB 1 10/31/50	800,000.00	402,136.00	
SPGB 1.2 10/31/40	1,700,000.00	1,120,555.00	
SPGB 1.25 10/31/30	2,300,000.00	1,992,697.00	
SPGB 1.3 10/31/26	2,400,000.00	2,260,224.00	
SPGB 1.4 04/30/28	2,000,000.00	1,841,860.00	
SPGB 1.4 07/30/28	1,200,000.00	1,100,100.00	
SPGB 1.45 04/30/29	2,100,000.00	1,902,768.00	
SPGB 1.45 10/31/27	1,800,000.00	1,674,972.00	
SPGB 1.45 10/31/71	400,000.00	179,348.00	
SPGB 1.5 04/30/27	1,500,000.00	1,410,060.00	
SPGB 1.6 04/30/25	1,400,000.00	1,359,596.00	

SPGB 1.85 07/30/35	1,600,000.00	1,317,344.00	
SPGB 1.95 04/30/26	2,400,000.00	2,318,016.00	
SPGB 1.95 07/30/30	700,000.00	639,870.00	
SPGB 2.15 10/31/25	1,600,000.00	1,562,384.00	
SPGB 2.35 07/30/33	700,000.00	628,901.00	
SPGB 2.55 10/31/32	1,600,000.00	1,479,440.00	
SPGB 2.7 10/31/48	750,000.00	589,732.50	
SPGB 2.75 10/31/24	1,200,000.00	1,188,972.00	
SPGB 2.8 05/31/26	800,000.00	788,568.00	
SPGB 2.9 10/31/46	1,700,000.00	1,409,793.00	
SPGB 3.15 04/30/33	900,000.00	868,815.00	
SPGB 3.45 07/30/66	1,300,000.00	1,109,602.00	
SPGB 3.9 07/30/39	200,000.00	198,240.00	
SPGB 4.2 01/31/37	1,050,000.00	1,093,134.00	
SPGB 4.65 07/30/25	800,000.00	817,984.00	
SPGB 4.7 07/30/41	1,500,000.00	1,637,085.00	
SPGB 4.9 07/30/40	1,400,000.00	1,557,738.00	
SPGB 5.15 10/31/28	1,500,000.00	1,630,095.00	
SPGB 5.15 10/31/44	1,400,000.00	1,622,432.00	
SPGB 5.75 07/30/32	1,000,000.00	1,171,420.00	
SPGB 5.9 07/30/26	500,000.00	534,585.00	
SPGB 6 01/31/29	1,900,000.00	2,150,078.00	
ユーロ小計	380,740,000.00	345,013,047.20 (54,332,654,673)	
国債証券合計		165,129,161,640 (165,129,161,640)	
合計		165,129,161,640 (165,129,161,640)	

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 232銘柄	47.7%	48.4%
カナダ・ドル	国債証券 28銘柄	2.0%	2.0%
オーストラリア・ドル	国債証券 20銘柄	1.5%	1.5%
シンガポール・ドル	国債証券 11銘柄	0.4%	0.4%
ニュージーランド・ドル	国債証券 8銘柄	0.2%	0.2%
イギリス・ポンド	国債証券 50銘柄	4.9%	5.0%
イスラエル・シケル	国債証券 8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 6銘柄	0.2%	0.2%
スウェーデン・クローナ	国債証券 6銘柄	0.2%	0.2%
メキシコ・ペソ	国債証券 11銘柄	1.0%	1.0%
オフショア・人民元	国債証券 25銘柄	6.5%	6.6%
マレーシア・リングギット	国債証券 10銘柄	0.5%	0.5%
ポーランド・ズロチ	国債証券 7銘柄	0.5%	0.5%
ユーロ	国債証券 279銘柄	32.5%	32.9%

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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）

## （1）貸借対照表

（単位：円）

	（2022年9月12日現在）	（2023年9月11日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	89,834,626	49,747,753
コール・ローン	2,524,951,156	2,105,981,016
株式	214,676,540,430	276,740,872,060
派生商品評価勘定	67,567,100	-
未収配当金	107,003,079	133,452,128
前払金	-	4,675,000
差入委託証拠金	112,590,000	79,050,000
流動資産合計	217,578,486,391	279,113,777,957
資産合計	217,578,486,391	279,113,777,957
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	2,218,500
前受金	53,125,000	-
未払解約金	116,384,998	294,798,093
その他未払費用	11,209	33,303
流動負債合計	169,521,207	297,049,896
負債合計	169,521,207	297,049,896
純資産の部		
元本等		
元本	64,681,311,514	67,733,425,616
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	152,727,653,670	211,083,302,445
元本等合計	217,408,965,184	278,816,728,061
純資産合計	217,408,965,184	278,816,728,061
負債純資産合計	217,578,486,391	279,113,777,957

## （2）注記表

## （重要な会計方針の注記）

項 目	自 2022年9月13日 至 2023年9月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。

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

（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9月12日現在）	（2023年9月11日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	64,681,311,514口	67,733,425,616口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.3612円 （1万口当たりの純資産額33,612円）	1口当たり純資産額 4.1164円 （1万口当たりの純資産額41,164円）

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年9月13日 至 2023年9月11日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券</p> <p>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引</p> <p>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p>

	<p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
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9月11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）</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9月12日現在）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物 0412月	2,654,052,900	-	2,721,620,000	67,567,100
	小計	2,654,052,900	-	2,721,620,000	67,567,100
合 計		2,654,052,900	-	2,721,620,000	67,567,100

（2023年9月11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	1,994,193,500	-	1,991,975,000	2,218,500
	小計	1,994,193,500	-	1,991,975,000	2,218,500
合 計		1,994,193,500	-	1,991,975,000	2,218,500

## （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。

## （関連当事者との取引に関する注記）

自 2022年9月13日 至 2023年9月11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9月12日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	60,456,249,906円
同期中における追加設定元本額	12,113,029,153円
同期中における一部解約元本額	7,887,967,545円

## 2022年9月12日現在の元本の内訳

三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,532,155,480円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	1,024,578,616円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,612,955,175円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,551,056,908円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	122,904,750円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	4,296,896円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	19,400,437円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	62,615,670円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	164,050,569円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	145,160,441円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	260,258,888円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,387,774,054円
三井住友・DCつみたてN I S A・日本株インデックスファンド	21,027,174,341円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	131,058,857円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	212,157,060円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	139,804,903円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	38,125,053円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	191,441,180円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	177,791,284円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	646,292,493円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	357,670,813円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	410,137,910円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	48,149,518円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	752,883,758円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	39,292,044円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	191,390,450円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	181,956,760円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	5,290,169円
日興F W S・日本株インデックス	1,165,067,037円
三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド	14,503,710円
S M A M・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,659,870,089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 >	12,478,245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 >	81,298,159円
S M A M・バランスファンドV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	1,595,955,250円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >	1,545,408,479円
S M A M・バランスファンドV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	5,856,077,396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 >	38,205,939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 >	147,542,596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 >	694,789,862円
S M A M・バランスファンドV L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	46,213,392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 >	254,234,553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 >	801,202,128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 >	559,229,424円
S M A M・バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	1,751,291,234円
S M A M・バランスV A株40T < 適格機関投資家限定 >	372,784円
S M A M・グローバルバランス40V A < 適格機関投資家限定 >	38,293,008円

SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	44,291,667円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	32,479,210円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	16,874,370円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	104,754,643円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	232,670,128円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	54,509,181円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	40,288,518円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	7,737,301円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	42,362,287円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	564,856,832円
SMAM・国内株式インデックスファンド・VA(適格機関投資家専用)	178,230,052円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	211,396,741円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	95,343,921円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	113,317,327円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	47,780,927円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	45,022,020円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	33,345,709円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	42,282,418円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	55,774,152円
SMDAM・日米3資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	18,136,348円
合計	64,681,311,514円

(2023年9月11日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	64,681,311,514円
同期中における追加設定元本額	11,902,850,475円
同期中における一部解約元本額	8,850,736,373円
2023年9月11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	9,591,481,988円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	1,007,680,143円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,516,293,931円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,642,841,830円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	162,411,744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)	3,566,971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)	15,726,214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)	56,375,030円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	157,876,103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)	147,286,974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)	270,312,573円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,281,339,864円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	25,135,439,200円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	263,303,999円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	336,243,520円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	202,765,236円
イオン・バランス戦略ファンド	87,515,647円



三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 5 0	49,107,745円
三井住友・資産最適化ファンド ( 1 安定重視型 )	203,601,343円
三井住友・資産最適化ファンド ( 2 やや安定型 )	191,016,426円
三井住友・資産最適化ファンド ( 3 バランス型 )	744,856,646円
三井住友・資産最適化ファンド ( 4 やや成長型 )	426,486,522円
三井住友・資産最適化ファンド ( 5 成長重視型 )	496,767,890円
三井住友・D C つみたてN I S A ・世界分散ファンド	54,438,122円
三井住友D S ・国内株式インデックス年金ファンド	1,079,692,316円
三井住友D S ・年金バランス 3 0 ( 債券重点型 )	39,416,892円
三井住友D S ・年金バランス 5 0 ( 標準型 )	231,146,504円
三井住友D S ・年金バランス 7 0 ( 株式重点型 )	239,344,365円
三井住友D S ・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 6 0	6,297,797円
日興F W S ・日本株インデックス	1,894,762,882円
三井住友D S ・T O P I X インデックス・ファンド	48,035,769円
三井住友D S ・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 3 5	43,516円
三井住友D S ・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 4 0	51,540円
三井住友D S ・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 4 5	61,241円
三井住友D S ・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 5 5	74,595円
三井住友D S ・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 6 5	74,595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 )	350,209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 )	3,814,930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 )	17,184,361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 )	8,499,319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 )	5,286,087円
S M A M ・国内株式パッシブ・ファンド ( 適格機関投資家専用 )	2,483,964,175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 >	8,759,088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 >	50,064,321円
S M A M ・バランスファンドV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	1,039,591,664円
S M A M ・バランスファンドV A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >	1,218,612,918円
S M A M ・バランスファンドV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	4,693,186,871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 >	31,653,541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 >	112,870,377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 >	608,209,715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 >	36,747,614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 >	201,101,365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 >	670,613,844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 >	432,830,639円
S M A M ・バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	1,339,067,175円
S M A M ・バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	322,605円
S M A M ・グローバルバランス 4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	29,607,883円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	31,750,643円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	26,636,479円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	14,740,890円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	72,250,966円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	183,363,073円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	39,684,868円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	33,340,590円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	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>	32,686,441円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	427,173,399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)	153,857,659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>	70,095,844円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	57,894,803円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	32,775,213円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	57,132,194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>	32,927,167円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	52,627,461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>	621,240,315円
SMDAM・日米3資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	18,098,332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>	32,461,404円
合計	67,733,425,616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	3,995.000	16,379,500	
ニッスイ	115,600	750.500	86,757,800	
マルハニチロ	17,100	2,620.500	44,810,550	
雪国まいたけ	11,400	912.000	10,396,800	
カネコ種苗	4,700	1,405.000	6,603,500	
サカタのタネ	13,200	4,245.000	56,034,000	
ホクト	10,100	1,853.000	18,715,300	
住石ホールディングス	14,400	399.000	5,745,600	
日鉄鉱業	4,500	5,490.000	24,705,000	
三井松島ホールディングス	5,500	2,835.000	15,592,500	
INPEX	427,200	2,202.500	940,908,000	
石油資源開発	13,300	5,310.000	70,623,000	
K&Oエナジーグループ	5,500	2,466.000	13,563,000	
ショーボンドホールディングス	15,700	5,929.000	93,085,300	
ミライト・ワン	38,100	1,977.000	75,323,700	
タマホーム	7,300	3,595.000	26,243,500	
日本アクア	5,000	999.000	4,995,000	
Robot Home	25,800	203.000	5,237,400	
安藤・間	66,300	1,235.000	81,880,500	
東急建設	32,300	811.000	26,195,300	
コムシスホールディングス	37,500	3,164.000	118,650,000	
ピーアールホールディングス	21,600	391.000	8,445,600	
高松コンストラクショングループ	7,200	2,672.000	19,238,400	

東建コーポレーション	3,200	7,670.000	24,544,000
ヤマウラ	6,900	1,264.000	8,721,600
オリエンタル白石	44,000	330.000	14,520,000
大成建設	75,700	5,214.000	394,699,800
大林組	288,900	1,351.500	390,448,350
清水建設	233,600	1,024.500	239,323,200
飛島建設	9,600	1,375.000	13,200,000
長谷工コーポレーション	83,000	1,856.000	154,048,000
松井建設	8,200	765.000	6,273,000
銭高組	1,500	3,960.000	5,940,000
鹿島建設	179,100	2,535.000	454,018,500
不動テトラ	5,600	1,942.000	10,875,200
鉄建建設	6,700	2,198.000	14,726,600
西松建設	13,900	3,801.000	52,833,900
三井住友建設	65,600	418.000	27,420,800
大豊建設	3,600	3,960.000	14,256,000
奥村組	12,900	4,630.000	59,727,000
東鉄工業	10,900	2,933.000	31,969,700
浅沼組	6,400	3,665.000	23,456,000
戸田建設	99,900	812.600	81,178,740
熊谷組	13,400	3,380.000	45,292,000
北野建設	1,900	3,135.000	5,956,500
矢作建設工業	11,500	1,286.000	14,789,000
ピーエス三菱	10,900	852.000	9,286,800
日本ハウスホールディングス	19,500	374.000	7,293,000
新日本建設	11,500	1,224.000	14,076,000
東亜道路工業	3,400	5,040.000	17,136,000
日本道路	1,700	9,670.000	16,439,000
東亜建設工業	7,100	3,630.000	25,773,000
日本国土開発	24,300	632.000	15,357,600
若築建設	3,900	3,030.000	11,817,000
東洋建設	26,300	1,129.000	29,692,700
五洋建設	114,600	898.100	102,922,260
世紀東急工業	10,800	1,675.000	18,090,000
福田組	3,100	4,825.000	14,957,500
住友林業	69,700	4,080.000	284,376,000
日本基礎技術	7,500	504.000	3,780,000
巴コーポレーション	11,500	544.000	6,256,000
大和ハウス工業	223,500	4,056.000	906,516,000
ライト工業	14,400	1,998.000	28,771,200
積水ハウス	244,900	3,074.000	752,822,600
日特建設	8,200	1,113.000	9,126,600
ユアテック	17,800	1,012.000	18,013,600
日本リーテック	7,700	1,283.000	9,879,100
四電工	3,500	2,865.000	10,027,500
中電工	11,500	2,442.000	28,083,000
関電工	43,600	1,341.000	58,467,600
きんでん	56,500	2,115.000	119,497,500

東京エネシス	8,700	1,010.000	8,787,000
トーエネック	2,900	4,260.000	12,354,000
住友電設	7,400	2,855.000	21,127,000
日本電設工業	13,200	2,256.000	29,779,200
エクシオグループ	36,800	3,153.000	116,030,400
新日本空調	4,600	2,514.000	11,564,400
九電工	19,700	4,609.000	90,797,300
三機工業	16,900	1,619.000	27,361,100
日揮ホールディングス	80,000	2,028.500	162,280,000
中外炉工業	3,300	2,077.000	6,854,100
ヤマト	7,000	940.000	6,580,000
太平電業	5,000	4,015.000	20,075,000
高砂熱学工業	19,300	2,927.000	56,491,100
三晃金属工業	1,300	4,165.000	5,414,500
朝日工業社	3,600	2,401.000	8,643,600
明星工業	14,800	975.000	14,430,000
大気社	9,200	4,705.000	43,286,000
ダイダン	5,300	3,015.000	15,979,500
日比谷総合設備	6,900	2,316.000	15,980,400
テスホールディングス	18,200	500.000	9,100,000
インフロニア・ホールディングス	84,500	1,544.000	130,468,000
東洋エンジニアリング	11,300	628.000	7,096,400
レイズネクスト	11,400	1,451.000	16,541,400
ニッポン	21,400	2,122.000	45,410,800
日清製粉グループ本社	75,000	1,937.000	145,275,000
日東富士製粉	1,700	4,910.000	8,347,000
昭和産業	6,700	3,075.000	20,602,500
鳥越製粉	10,700	668.000	7,147,600
中部飼料	11,300	1,144.000	12,927,200
フィード・ワン	12,900	815.000	10,513,500
日本甜菜製糖	5,200	1,926.000	10,015,200
DM三井製糖ホールディングス	7,900	3,050.000	24,095,000
ウェルネオシュガー	4,700	2,032.000	9,550,400
森永製菓	14,500	5,430.000	78,735,000
中村屋	2,800	3,110.000	8,708,000
江崎グリコ	23,200	3,942.000	91,454,400
井村屋グループ	4,800	2,323.000	11,150,400
不二家	5,700	2,485.000	14,164,500
山崎製パン	54,600	2,890.000	157,794,000
モロゾフ	2,800	3,660.000	10,248,000
亀田製菓	5,100	4,400.000	22,440,000
寿スピリッツ	8,600	11,950.000	102,770,000
カルビー	37,300	2,966.500	110,650,450
森永乳業	14,800	5,779.000	85,529,200
六甲バター	6,300	1,440.000	9,072,000
ヤクルト本社	58,100	7,502.000	435,866,200
明治ホールディングス	99,500	3,692.000	367,354,000
雪印メグミルク	19,500	2,312.000	45,084,000

プリマハム	10,600	2,491.000	26,404,600
日本ハム	31,700	4,555.000	144,393,500
丸大食品	8,400	1,713.000	14,389,200
S Foods	8,900	3,365.000	29,948,500
柿安本店	3,300	2,555.000	8,431,500
伊藤ハム米久ホールディングス	60,500	801.000	48,460,500
サッポロホールディングス	26,700	4,674.000	124,795,800
アサヒグループホールディングス	187,500	5,753.000	1,078,687,500
キリンホールディングス	338,300	2,055.500	695,375,650
宝ホールディングス	54,800	1,242.000	68,061,600
オエノンホールディングス	26,200	433.000	11,344,600
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	63,600	1,968.000	125,164,800
ライフドリンク カンパニー	1,700	3,935.000	6,689,500
サントリー食品インターナショナル	57,100	4,721.000	269,569,100
ダイドーグループホールディングス	4,500	5,820.000	26,190,000
伊藤園	27,500	4,755.000	130,762,500
キーコーヒー	8,400	2,051.000	17,228,400
日清オイリオグループ	11,300	4,190.000	47,347,000
不二製油グループ本社	18,900	2,321.500	43,876,350
かどや製油	1,800	3,525.000	6,345,000
J - オイルミルズ	8,300	1,799.000	14,931,700
キッコーマン	53,700	8,314.000	446,461,800
味の素	196,000	6,097.000	1,195,012,000
ブルドックソース	4,700	2,066.000	9,710,200
キュービー	43,600	2,454.000	106,994,400
ハウス食品グループ本社	24,800	3,183.000	78,938,400
カゴメ	36,400	3,347.000	121,830,800
アリアケジャパン	7,200	5,069.000	36,496,800
エバラ食品工業	2,800	2,960.000	8,288,000
ニチレイ	37,300	3,547.000	132,303,100
東洋水産	41,100	5,852.000	240,517,200
イトアンドホールディングス	4,100	2,135.000	8,753,500
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,800	1,421.000	8,241,800
日清食品ホールディングス	28,600	12,720.000	363,792,000
永谷園ホールディングス	4,200	2,319.000	9,739,800
フジッコ	7,600	1,957.000	14,873,200
ロック・フィールド	9,100	1,636.000	14,887,600
日本たばこ産業	493,400	3,230.000	1,593,682,000
ケンコーマヨネーズ	6,300	1,458.000	9,185,400
わらべや日洋ホールディングス	6,200	2,884.000	17,880,800
なとり	5,400	1,981.000	10,697,400
ファーマフーズ	11,800	1,545.000	18,231,000
ユーグレナ	51,500	817.000	42,075,500
紀文食品	7,100	1,117.000	7,930,700
ピククルスホールディングス	5,200	1,242.000	6,458,400
ミヨシ油脂	5,200	1,175.000	6,110,000
理研ビタミン	7,200	2,310.000	16,632,000

片倉工業	9,000	1,752.000	15,768,000
グンゼ	5,900	4,590.000	27,081,000
東洋紡	36,100	1,083.500	39,114,350
ユニチカ	30,500	220.000	6,710,000
富士紡ホールディングス	3,500	3,580.000	12,530,000
倉敷紡績	6,600	2,429.000	16,031,400
シキボウ	6,100	1,077.000	6,569,700
日本毛織	21,800	1,307.000	28,492,600
帝国繊維	9,300	1,961.000	18,237,300
帝人	79,700	1,454.500	115,923,650
東レ	554,100	799.700	443,113,770
ダイニック	6,300	807.000	5,084,100
セーレン	16,000	2,300.000	36,800,000
小松マテーレ	13,300	745.000	9,908,500
ワコールホールディングス	15,300	3,229.000	49,403,700
ホギメディカル	11,200	3,275.000	36,680,000
T S Iホールディングス	28,500	760.000	21,660,000
ワールド	10,800	1,664.000	17,971,200
三陽商会	2,800	2,085.000	5,838,000
オンワードホールディングス	54,600	550.000	30,030,000
ルックホールディングス	2,600	2,003.000	5,207,800
ゴールドウイン	14,700	10,505.000	154,423,500
デサント	14,300	3,575.000	51,122,500
特種東海製紙	4,000	3,370.000	13,480,000
王子ホールディングス	344,400	629.000	216,627,600
日本製紙	43,600	1,302.000	56,767,200
北越コーポレーション	52,700	957.000	50,433,900
大王製紙	37,000	1,260.500	46,638,500
レンゴー	75,900	999.200	75,839,280
トーモク	5,400	2,366.000	12,776,400
ザ・パックス	6,200	3,140.000	19,468,000
北の達人コーポレーション	37,700	249.000	9,387,300
クラレ	122,300	1,677.000	205,097,100
旭化成	515,500	949.700	489,570,350
レゾナック・ホールディングス	79,700	2,505.500	199,688,350
住友化学	611,800	413.000	252,673,400
住友精化	3,500	4,600.000	16,100,000
日産化学	38,900	6,330.000	246,237,000
ラサ工業	3,500	2,064.000	7,224,000
クレハ	6,800	8,630.000	58,684,000
多木化学	3,300	3,625.000	11,962,500
テイカ	5,900	1,354.000	7,988,600
石原産業	14,800	1,494.000	22,111,200
日本曹達	8,800	5,450.000	47,960,000
東ソー	110,000	1,942.000	213,620,000
トクヤマ	26,600	2,380.500	63,321,300
セントラル硝子	13,300	2,940.000	39,102,000
東亜合成	41,100	1,376.500	56,574,150

大阪ソーダ	5,000	6,700.000	33,500,000
関東電化工業	16,400	887.000	14,546,800
デンカ	30,100	2,773.000	83,467,300
信越化学工業	686,300	4,578.000	3,141,881,400
堺化学工業	6,300	2,049.000	12,908,700
第一稀元素化学工業	8,000	961.000	7,688,000
エア・ウォーター	78,000	1,856.500	144,807,000
日本酸素ホールディングス	80,000	3,563.000	285,040,000
日本化学工業	3,000	1,936.000	5,808,000
日本パーカラライジング	39,800	1,178.000	46,884,400
高压ガス工業	12,800	787.000	10,073,600
四国化成ホールディングス	11,000	1,448.000	15,928,000
戸田工業	2,100	1,940.000	4,074,000
ステラ ケミファ	5,000	3,250.000	16,250,000
保土谷化学工業	2,400	3,310.000	7,944,000
日本触媒	12,600	5,543.000	69,841,800
大日精化工業	5,800	2,346.000	13,606,800
カネカ	18,600	4,137.000	76,948,200
三菱瓦斯化学	61,100	2,056.000	125,621,600
三井化学	67,900	3,869.000	262,705,100
J S R	77,200	4,049.000	312,582,800
東京応化工業	13,300	9,351.000	124,368,300
大阪有機化学工業	6,800	2,525.000	17,170,000
三菱ケミカルグループ	557,400	908.100	506,174,940
K Hネオケム	13,300	2,267.000	30,151,100
ダイセル	117,400	1,282.500	150,565,500
住友ベークライト	12,200	6,646.000	81,081,200
積水化学工業	167,000	2,241.500	374,330,500
日本ゼオン	49,700	1,608.000	79,917,600
アイカ工業	20,700	3,442.000	71,249,400
U B E	42,300	2,527.000	106,892,100
積水樹脂	11,300	2,363.000	26,701,900
タキロンシーアイ	18,900	586.000	11,075,400
旭有機材	5,500	3,865.000	21,257,500
ニチバン	5,700	1,887.000	10,755,900
リケンテクノス	18,200	754.000	13,722,800
大倉工業	4,000	2,586.000	10,344,000
群栄化学工業	2,100	3,420.000	7,182,000
ミライアル	2,700	1,386.000	3,742,200
ダイキョーニシカワ	18,600	820.000	15,252,000
森六ホールディングス	4,400	2,265.000	9,966,000
恵和	6,100	1,281.000	7,814,100
日本化薬	62,200	1,309.000	81,419,800
カーリットホールディングス	8,700	969.000	8,430,300
日本精化	4,800	2,441.000	11,716,800
扶桑化学工業	7,500	4,075.000	30,562,500
トリケミカル研究所	11,000	2,882.000	31,702,000
A D E K A	28,400	2,779.500	78,937,800

日油	25,500	6,691.000	170,620,500
新日本理化	15,600	237.000	3,697,200
ハリマ化成グループ	5,800	847.000	4,912,600
花王	186,900	5,555.000	1,038,229,500
第一工業製薬	3,300	1,693.000	5,586,900
石原ケミカル	4,200	1,619.000	6,799,800
三洋化成工業	4,800	4,155.000	19,944,000
大日本塗料	10,800	1,008.000	10,886,400
日本ペイントホールディングス	438,600	1,161.000	509,214,600
関西ペイント	67,100	2,298.000	154,195,800
中国塗料	13,800	1,455.000	20,079,000
日本特殊塗料	5,200	1,417.000	7,368,400
藤倉化成	12,900	492.000	6,346,800
太陽ホールディングス	12,300	2,543.000	31,278,900
D I C	32,000	2,480.500	79,376,000
サカタインクス	18,300	1,365.000	24,979,500
東洋インキS Cホールディングス	17,200	2,281.000	39,233,200
富士フイルムホールディングス	158,600	8,776.000	1,391,873,600
資生堂	172,700	5,650.000	975,755,000
ライオン	108,600	1,524.000	165,506,400
高砂香料工業	5,600	2,931.000	16,413,600
マンダム	17,900	1,430.000	25,597,000
ミルボン	11,700	4,602.000	53,843,400
ファンケル	36,300	2,474.000	89,806,200
コーセー	16,800	11,765.000	197,652,000
コタ	8,000	1,624.000	12,992,000
ポーラ・オルビスホールディングス	42,600	1,841.500	78,447,900
ノエビアホールディングス	7,300	5,670.000	41,391,000
新日本製薬	5,000	1,570.000	7,850,000
アクシージア	4,800	1,171.000	5,620,800
エステー	7,100	1,541.000	10,941,100
アグロ カネショウ	3,900	1,380.000	5,382,000
コニシ	13,700	2,574.000	35,263,800
長谷川香料	15,800	3,365.000	53,167,000
小林製薬	24,100	7,077.000	170,555,700
荒川化学工業	7,700	1,046.000	8,054,200
メック	6,700	3,865.000	25,895,500
日本高純度化学	2,400	2,609.000	6,261,600
タカラバイオ	22,200	1,411.000	31,324,200
J C U	9,200	3,370.000	31,004,000
新田ゼラチン	6,000	719.000	4,314,000
O A Tアグリオ	2,700	1,800.000	4,860,000
デクセリアルズ	23,000	3,616.000	83,168,000
アース製薬	7,400	4,910.000	36,334,000
北興化学工業	9,600	922.000	8,851,200
大成ラミック	3,500	3,190.000	11,165,000
クミアイ化学工業	33,100	1,048.000	34,688,800
日本農薬	15,900	680.000	10,812,000



アキレス	5,700	1,489.000	8,487,300
有沢製作所	14,400	1,051.000	15,134,400
日東電工	59,900	10,070.000	603,193,000
レック	12,800	950.000	12,160,000
三光合成	11,700	720.000	8,424,000
きもと	21,600	187.000	4,039,200
藤森工業	6,300	3,985.000	25,105,500
前澤化成工業	5,900	1,526.000	9,003,400
未来工業	3,200	3,335.000	10,672,000
J S P	6,000	2,008.000	12,048,000
エフピコ	15,900	2,686.500	42,715,350
天馬	6,400	2,548.000	16,307,200
信越ポリマー	14,800	1,356.000	20,068,800
東リ	20,000	351.000	7,020,000
ニフコ	29,800	4,260.000	126,948,000
バルカー	6,800	4,290.000	29,172,000
ユニ・チャーム	172,400	5,669.000	977,335,600
協和キリン	99,800	2,616.500	261,126,700
武田薬品工業	731,800	4,545.000	3,326,031,000
アステラス製薬	781,200	2,184.500	1,706,531,400
住友ファーマ	61,900	512.400	31,717,560
塩野義製薬	104,200	6,486.000	675,841,200
日本新薬	19,500	6,464.000	126,048,000
中外製薬	258,800	4,477.000	1,158,647,600
科研製薬	14,000	3,551.000	49,714,000
エーザイ	100,600	8,991.000	904,494,600
ロート製薬	80,200	3,944.000	316,308,800
小野薬品工業	159,700	2,851.000	455,304,700
久光製薬	18,400	5,263.000	96,839,200
持田製薬	9,200	3,330.000	30,636,000
参天製薬	150,700	1,403.000	211,432,100
扶桑薬品工業	3,000	2,179.000	6,537,000
ツムラ	25,900	2,749.500	71,212,050
キッセイ薬品工業	12,200	3,360.000	40,992,000
生化学工業	15,900	823.000	13,085,700
栄研化学	13,300	1,380.000	18,354,000
鳥居薬品	4,300	3,770.000	16,211,000
J C Rファーマ	28,500	1,241.000	35,368,500
東和薬品	12,700	2,803.000	35,598,100
富士製薬工業	6,900	1,208.000	8,335,200
ゼリア新薬工業	11,300	2,396.000	27,074,800
ソーせいグループ	26,900	1,625.000	43,712,500
第一三共	720,400	4,119.000	2,967,327,600
杏林製薬	17,400	1,778.000	30,937,200
大幸薬品	18,100	344.000	6,226,400
ダイト	6,380	2,371.000	15,126,980
大塚ホールディングス	171,900	5,349.000	919,493,100
大正製薬ホールディングス	18,600	6,186.000	115,059,600

ペプチドリーム	40,300	1,670.000	67,301,000
あすか製薬ホールディングス	8,600	1,684.000	14,482,400
サワイグループホールディングス	19,000	4,328.000	82,232,000
日本コークス工業	83,300	117.000	9,746,100
ニチレキ	9,600	2,028.000	19,468,800
ユシロ化学工業	5,800	1,563.000	9,065,400
富士石油	22,100	329.000	7,270,900
出光興産	91,600	3,334.000	305,394,400
E N E O Sホールディングス	1,402,900	582.600	817,329,540
コスモエネルギーホールディングス	32,800	5,628.000	184,598,400
横浜ゴム	42,200	2,883.000	121,662,600
TOYO TIRE	47,400	2,238.000	106,081,200
ブリヂストン	242,000	5,644.000	1,365,848,000
住友ゴム工業	81,100	1,561.000	126,597,100
オカモト	4,500	4,700.000	21,150,000
フコク	5,000	1,475.000	7,375,000
ニッタ	8,200	3,415.000	28,003,000
住友理工	16,600	1,101.000	18,276,600
三ツ星ベルト	12,000	4,930.000	59,160,000
バンドー化学	12,700	1,630.000	20,701,000
日東紡績	9,600	3,785.000	36,336,000
A G C	77,300	5,177.000	400,182,100
日本山村硝子	2,400	1,838.000	4,411,200
日本電気硝子	33,500	2,608.000	87,368,000
オハラ	5,300	1,289.000	6,831,700
住友大阪セメント	11,800	3,763.000	44,403,400
太平洋セメント	52,600	2,706.000	142,335,600
日本ヒューム	11,000	914.000	10,054,000
日本コンクリート工業	21,500	324.000	6,966,000
三谷セキサン	3,600	5,010.000	18,036,000
アジアパイルホールディングス	18,500	675.000	12,487,500
東海カーボン	76,300	1,157.000	88,279,100
日本カーボン	4,900	4,440.000	21,756,000
東洋炭素	6,100	5,720.000	34,892,000
ノリタケカンパニーリミテド	4,500	6,380.000	28,710,000
T O T O	54,500	3,937.000	214,566,500
日本碍子	95,900	1,931.000	185,182,900
日本特殊陶業	62,900	3,464.000	217,885,600
ダントーホールディングス	4,700	961.000	4,516,700
M A R U W A	3,200	26,330.000	84,256,000
品川リフラクトリーズ	2,600	8,020.000	20,852,000
黒崎播磨	1,800	10,090.000	18,162,000
ヨータイ	6,200	1,512.000	9,374,400
東京窯業	13,600	347.000	4,719,200
フジインコーポレーテッド	20,000	3,240.000	64,800,000
ニチアス	21,000	3,030.000	63,630,000
ニチハ	10,500	3,095.000	32,497,500
日本製鉄	380,800	3,539.000	1,347,651,200

神戸製鋼所	171,000	2,027.500	346,702,500
中山製鋼所	18,000	967.000	17,406,000
合同製鐵	4,400	4,730.000	20,812,000
J F E ホールディングス	227,000	2,240.000	508,480,000
東京製鐵	24,100	1,706.000	41,114,600
共英製鋼	9,600	2,066.000	19,833,600
大和工業	13,900	7,218.000	100,330,200
東京鐵鋼	4,300	3,665.000	15,759,500
大阪製鐵	5,300	1,760.000	9,328,000
淀川製鋼所	9,300	3,550.000	33,015,000
中部鋼板	7,300	2,183.000	15,935,900
丸一鋼管	25,700	3,722.000	95,655,400
モリ工業	2,000	3,775.000	7,550,000
大同特殊鋼	10,700	6,182.000	66,147,400
日本冶金工業	6,200	4,750.000	29,450,000
山陽特殊製鋼	8,200	2,858.000	23,435,600
愛知製鋼	5,100	4,185.000	21,343,500
大平洋金属	6,300	1,538.000	9,689,400
新日本電工	50,900	281.000	14,302,900
栗本鐵工所	4,600	2,818.000	12,962,800
三菱製鋼	5,800	1,576.000	9,140,800
日本精線	1,300	4,845.000	6,298,500
新家工業	2,000	2,950.000	5,900,000
大紀アルミニウム工業所	12,200	1,441.000	17,580,200
日本軽金属ホールディングス	22,800	1,605.000	36,594,000
三井金属鉱業	24,800	3,792.000	94,041,600
東邦亜鉛	5,600	1,689.000	9,458,400
三菱マテリアル	57,000	2,489.500	141,901,500
住友金属鉱山	98,800	4,457.000	440,351,600
D O W A ホールディングス	19,200	4,673.000	89,721,600
古河機械金属	12,900	1,823.000	23,516,700
大阪チタニウムテクノロジーズ	12,700	3,240.000	41,148,000
東邦チタニウム	15,700	1,842.000	28,919,400
U A C J	12,000	3,055.000	36,660,000
C K サンエツ	2,400	3,695.000	8,868,000
古河電気工業	28,500	2,549.500	72,660,750
住友電気工業	294,100	1,756.500	516,586,650
フジクラ	91,600	1,194.500	109,416,200
S W C C	9,700	1,995.000	19,351,500
平河ヒューテック	5,500	1,464.000	8,052,000
リョービ	9,300	2,901.000	26,979,300
アーレスティ	8,500	818.000	6,953,000
A R E ホールディングス	34,600	1,906.000	65,947,600
稲葉製作所	6,200	1,560.000	9,672,000
宮地エンジニアリンググループ	2,400	6,160.000	14,784,000
トーカロ	22,100	1,425.000	31,492,500
アルファ	4,200	1,566.000	6,577,200
S U M C O	151,100	1,930.000	291,623,000

川田テクノロジーズ	2,300	6,140.000	14,122,000
RS TECHNOLOGIES	5,900	2,743.000	16,183,700
ジェイテックコーポレーション	1,200	2,566.000	3,079,200
信和	9,900	786.000	7,781,400
東洋製罐グループホールディングス	50,900	2,567.500	130,685,750
ホッカンホールディングス	5,500	1,586.000	8,723,000
横河ブリッジホールディングス	10,500	2,791.000	29,305,500
三和ホールディングス	78,000	2,269.000	176,982,000
文化シャッター	24,000	1,115.000	26,760,000
三協立山	10,700	910.000	9,737,000
アルインコ	7,600	1,082.000	8,223,200
LIXIL	124,000	1,833.500	227,354,000
ノーリツ	13,800	1,589.000	21,928,200
長府製作所	8,400	2,089.000	17,547,600
リンナイ	46,200	2,821.000	130,330,200
日東精工	13,700	555.000	7,603,500
岡部	16,500	754.000	12,441,000
ジーテクト	9,300	1,820.000	16,926,000
東プレ	14,900	1,764.000	26,283,600
高周波熱錬	14,000	1,020.000	14,280,000
東京製綱	5,700	1,328.000	7,569,600
パイオラックス	11,600	2,372.000	27,515,200
エイチワン	9,600	804.000	7,718,400
日本発条	75,100	1,126.500	84,600,150
立川ブラインド工業	4,600	1,446.000	6,651,600
三益半導体工業	6,400	2,783.000	17,811,200
日本製鋼所	22,900	2,925.500	66,993,950
三浦工業	34,600	3,142.000	108,713,200
タクマ	25,200	1,621.000	40,849,200
ツガミ	18,000	1,175.000	21,150,000
オークマ	8,100	6,905.000	55,930,500
芝浦機械	8,300	4,240.000	35,192,000
アマダ	131,500	1,539.500	202,444,250
アイダエンジニアリング	16,400	993.000	16,285,200
TAKISAWA	1,800	2,561.000	4,609,800
FUJI	35,800	2,364.500	84,649,100
牧野フライス製作所	9,100	6,880.000	62,608,000
オーエスジー	38,200	1,825.500	69,734,100
旭ダイヤモンド工業	23,100	908.000	20,974,800
DMG森精機	50,200	2,638.000	132,427,600
ソディック	22,400	723.000	16,195,200
ディスコ	40,100	27,215.000	1,091,321,500
日東工器	4,400	1,974.000	8,685,600
日進工具	7,100	1,120.000	7,952,000
豊和工業	5,500	799.000	4,394,500
石川製作所	3,100	1,278.000	3,961,800
島精機製作所	13,500	1,877.000	25,339,500
オプトラン	13,700	1,839.000	25,194,300

NCホールディングス	2,000	1,697.000	3,394,000
イワキ	6,300	1,998.000	12,587,400
フリー	9,200	1,679.000	15,446,800
ヤマシンフィルタ	21,800	345.000	7,521,000
日阪製作所	8,800	975.000	8,580,000
やまびこ	13,300	1,480.000	19,684,000
野村マイクロ・サイエンス	2,800	6,100.000	17,080,000
平田機工	4,000	7,840.000	31,360,000
PEGASUS	11,000	606.000	6,666,000
マルマエ	4,300	1,780.000	7,654,000
タツモ	5,200	3,305.000	17,186,000
ナブテスコ	52,100	2,812.500	146,531,250
三井海洋開発	10,600	1,847.000	19,578,200
レオン自動機	9,100	1,346.000	12,248,600
S M C	27,000	68,500.000	1,849,500,000
ホソカワミクロン	5,700	4,145.000	23,626,500
ユニオンツール	3,600	3,810.000	13,716,000
瑞光	6,500	1,316.000	8,554,000
オイレス工業	11,100	2,064.000	22,910,400
日精エー・エス・ビー機械	3,400	4,370.000	14,858,000
サトーホールディングス	11,600	2,061.000	23,907,600
技研製作所	8,100	2,056.000	16,653,600
日本エアーテック	5,100	1,287.000	6,563,700
日精樹脂工業	6,900	1,056.000	7,286,400
ワイエイシイホールディングス	2,700	2,864.000	7,732,800
小松製作所	390,000	4,330.000	1,688,700,000
住友重機械工業	48,900	3,719.000	181,859,100
日立建機	33,000	4,707.000	155,331,000
日工	12,800	678.000	8,678,400
巴工業	3,800	3,075.000	11,685,000
井関農機	8,400	1,188.000	9,979,200
T O W A	8,400	3,935.000	33,054,000
ローツェ	4,300	11,270.000	48,461,000
クボタ	436,600	2,344.500	1,023,608,700
荏原実業	4,500	2,953.000	13,288,500
三菱化工機	2,900	2,771.000	8,035,900
月島ホールディングス	11,500	1,403.000	16,134,500
帝国電機製作所	5,900	2,662.000	15,705,800
新東工業	16,700	1,110.000	18,537,000
澁谷工業	8,000	2,581.000	20,648,000
アイチコーポレーション	11,800	950.000	11,210,000
小森コーポレーション	19,300	1,106.000	21,345,800
鶴見製作所	6,300	3,080.000	19,404,000
酒井重工業	1,400	5,290.000	7,406,000
荏原製作所	34,000	7,217.000	245,378,000
西島製作所	7,600	1,994.000	15,154,400
北越工業	8,700	2,150.000	18,705,000
ダイキン工業	99,400	24,885.000	2,473,569,000

オルガノ	11,500	3,855.000	44,332,500
トーヨーカネツ	3,400	3,440.000	11,696,000
栗田工業	46,500	5,506.000	256,029,000
椿本チエイン	11,500	3,930.000	45,195,000
大同工業	6,300	738.000	4,649,400
木村化工機	8,700	760.000	6,612,000
アネスト岩田	14,100	1,203.000	16,962,300
ダイフク	128,500	2,654.000	341,039,000
サムコ	2,300	4,985.000	11,465,500
加藤製作所	4,300	1,290.000	5,547,000
タダノ	47,500	1,301.000	61,797,500
フジテック	29,200	3,600.000	105,120,000
C K D	23,900	2,100.000	50,190,000
平和	27,700	2,232.000	61,826,400
理想科学工業	7,200	2,322.000	16,718,400
S A N K Y O	16,400	6,381.000	104,648,400
日本金銭機械	9,900	1,008.000	9,979,200
マースグループホールディングス	5,100	2,863.000	14,601,300
フクシマガリレイ	6,100	5,130.000	31,293,000
ダイコク電機	4,700	5,620.000	26,414,000
竹内製作所	15,100	4,945.000	74,669,500
アマノ	23,600	3,260.000	76,936,000
J U K I	13,700	624.000	8,548,800
ジャノメ	9,400	692.000	6,504,800
マックス	10,500	2,692.000	28,266,000
グローリー	20,100	3,107.000	62,450,700
新晃工業	8,200	2,067.000	16,949,400
大和冷機工業	12,400	1,439.000	17,843,600
セガサミーホールディングス	67,000	2,810.000	188,270,000
リケン	3,500	3,320.000	11,620,000
T P R	9,300	1,859.000	17,288,700
ツバキ・ナカシマ	19,100	807.000	15,413,700
ホシザキ	49,700	5,703.000	283,439,100
大豊工業	8,300	874.000	7,254,200
日本精工	152,100	847.200	128,859,120
N T N	163,400	284.800	46,536,320
ジェイテクト	73,400	1,397.000	102,539,800
不二越	6,300	4,080.000	25,704,000
日本トムソン	20,600	566.000	11,659,600
T H K	47,800	2,658.000	127,052,400
ユーシン精機	7,700	697.000	5,366,900
前澤給装工業	6,300	1,230.000	7,749,000
イーグル工業	9,300	1,740.000	16,182,000
前澤工業	5,600	1,041.000	5,829,600
日本ピラー工業	7,800	4,105.000	32,019,000
キッツ	30,000	1,031.000	30,930,000
マキタ	103,600	3,833.000	397,098,800
三井E & S	40,700	623.000	25,356,100

日立造船	68,100	860.000	58,566,000
三菱重工業	145,600	8,781.000	1,278,513,600
I H I	52,400	3,783.000	198,229,200
スター精密	15,100	1,869.000	28,221,900
日清紡ホールディングス	65,200	1,082.000	70,546,400
イビデン	47,700	8,420.000	401,634,000
コニカミノルタ	186,200	465.900	86,750,580
ブラザー工業	111,300	2,429.000	270,347,700
ミネベアミツミ	144,400	2,342.500	338,257,000
日立製作所	404,900	10,015.000	4,055,073,500
東芝	160,500	4,604.000	738,942,000
三菱電機	860,700	1,889.500	1,626,292,650
富士電機	50,600	6,816.000	344,889,600
東洋電機製造	5,000	1,003.000	5,015,000
安川電機	98,600	5,708.000	562,808,800
シンフォニア テクノロジー	10,000	1,592.000	15,920,000
明電舎	12,500	2,219.000	27,737,500
オリジン	3,500	1,267.000	4,434,500
山洋電気	3,600	6,960.000	25,056,000
デンヨー	6,900	2,105.000	14,524,500
PHCホールディングス	11,600	1,509.000	17,504,400
ソシオネクスト	12,000	15,490.000	185,880,000
東芝テック	12,500	3,430.000	42,875,000
芝浦メカトロニクス	1,500	21,870.000	32,805,000
マブチモーター	20,700	4,485.000	92,839,500
ニデック	202,600	7,340.000	1,487,084,000
トレックス・セミコンダクター	4,100	2,284.000	9,364,400
東光高岳	5,300	2,167.000	11,485,100
ダブル・スコープ	24,100	1,119.000	26,967,900
ダイヘン	7,400	5,270.000	38,998,000
ヤーマン	15,200	1,049.000	15,944,800
JVCケンウッド	76,500	667.000	51,025,500
ミマキエンジニアリング	9,000	755.000	6,795,000
I - P E X	6,200	1,650.000	10,230,000
大崎電気工業	21,500	651.000	13,996,500
オムロン	76,300	6,813.000	519,831,900
日東工業	11,200	3,825.000	42,840,000
I D E C	12,300	3,120.000	38,376,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	27,300	2,677.500	73,095,750
メルコホールディングス	2,400	3,140.000	7,536,000
日本電気	117,700	8,090.000	952,193,000
富士通	83,000	18,330.000	1,521,390,000
沖電気工業	37,500	1,063.000	39,862,500
電気興業	3,700	2,496.000	9,235,200
サンケン電気	7,700	9,800.000	75,460,000
アイホン	5,400	2,919.000	15,762,600
ルネサスエレクトロニクス	543,500	2,329.500	1,266,083,250
セイコーエプソン	106,700	2,255.500	240,661,850

ワコム	63,400	614.000	38,927,600
アルバック	19,700	5,616.000	110,635,200
アクセル	2,800	1,807.000	5,059,600
E I Z O	6,100	5,130.000	31,293,000
日本信号	19,000	961.000	18,259,000
京三製作所	19,500	458.000	8,931,000
能美防災	11,200	1,822.000	20,406,400
ホーチキ	6,700	1,642.000	11,001,400
エレコム	19,900	1,791.000	35,640,900
パナソニック ホールディングス	983,700	1,661.500	1,634,417,550
シャープ	100,600	923.200	92,873,920
アンリツ	59,000	1,087.000	64,133,000
富士通ゼネラル	23,800	2,826.000	67,258,800
ソニーグループ	583,200	12,465.000	7,269,588,000
T D K	131,700	5,270.000	694,059,000
帝国通信工業	4,100	1,951.000	7,999,100
タムラ製作所	36,200	579.000	20,959,800
アルプスアルパイン	74,600	1,214.000	90,564,400
日本電波工業	10,800	1,470.000	15,876,000
鈴木	5,500	1,093.000	6,011,500
メイコー	9,100	3,495.000	31,804,500
日本トリム	2,200	3,005.000	6,611,000
ローランド ディー . ジー .	4,600	3,485.000	16,031,000
フォスター電機	8,700	928.000	8,073,600
S M K	2,500	2,572.000	6,430,000
ヨコオ	7,300	1,647.000	12,023,100
ホシデン	19,300	1,872.000	36,129,600
ヒロセ電機	13,400	17,075.000	228,805,000
日本航空電子工業	16,900	3,055.000	51,629,500
T O A	10,100	1,115.000	11,261,500
マクセル	17,400	1,601.000	27,857,400
古野電気	11,500	1,325.000	15,237,500
スミダコーポレーション	11,300	1,560.000	17,628,000
アイコム	3,600	3,455.000	12,438,000
リオン	3,800	2,360.000	8,968,000
横河電機	91,100	2,942.500	268,061,750
新電元工業	3,400	3,160.000	10,744,000
アズビル	57,600	4,856.000	279,705,600
東亜ディーケーケー	6,000	878.000	5,268,000
日本光電工業	38,200	3,860.000	147,452,000
チノー	4,000	2,040.000	8,160,000
日本電子材料	6,200	1,526.000	9,461,200
堀場製作所	16,100	7,673.000	123,535,300
アドバンテスト	64,900	16,910.000	1,097,459,000
エスベック	7,100	2,461.000	17,473,100
キーエンス	82,500	57,490.000	4,742,925,000
日置電機	4,100	7,450.000	30,545,000
シスメックス	71,200	7,623.000	542,757,600



日本マイクロニクス	14,800	2,183.000	32,308,400
メガチップス	6,800	4,140.000	28,152,000
OBARA GROUP	4,900	4,120.000	20,188,000
コーセル	10,600	1,290.000	13,674,000
イリソ電子工業	7,600	4,300.000	32,680,000
オブテックスグループ	15,100	1,698.000	25,639,800
千代田インテグレ	3,700	2,894.000	10,707,800
レーザーテック	37,800	21,310.000	805,518,000
スタンレー電気	58,000	2,439.500	141,491,000
ウシオ電機	41,800	1,876.000	78,416,800
ヘリオス テクノ ホールディング	6,300	428.000	2,696,400
日本セラミック	8,000	2,569.000	20,552,000
古河電池	6,500	972.000	6,318,000
山一電機	7,300	1,767.000	12,899,100
図研	7,200	4,330.000	31,176,000
日本電子	20,600	4,581.000	94,368,600
カシオ計算機	61,300	1,241.000	76,073,300
ファナック	402,100	4,053.000	1,629,711,300
日本シイエムケイ	19,800	652.000	12,909,600
エンプラス	2,500	11,300.000	28,250,000
大真空	10,800	797.000	8,607,600
ローム	38,100	11,590.000	441,579,000
浜松ホトニクス	66,000	6,601.000	435,666,000
三井ハイテック	8,500	9,430.000	80,155,000
新光電気工業	29,100	5,880.000	171,108,000
京セラ	128,000	7,396.000	946,688,000
太陽誘電	40,100	4,229.000	169,582,900
村田製作所	249,900	8,147.000	2,035,935,300
双葉電子工業	17,400	553.000	9,622,200
北陸電気工業	3,200	1,493.000	4,777,600
ニチコン	16,800	1,365.000	22,932,000
KOA	12,600	1,818.000	22,906,800
市光工業	15,900	562.000	8,935,800
小糸製作所	98,900	2,359.500	233,354,550
ミツバ	16,200	770.000	12,474,000
SCREENホールディングス	14,100	14,030.000	197,823,000
キヤノン電子	9,100	1,847.000	16,807,700
キヤノン	411,300	3,579.000	1,472,042,700
リコー	206,900	1,226.500	253,762,850
象印マホービン	23,500	1,830.000	43,005,000
東京エレクトロン	174,500	20,490.000	3,575,505,000
イノテック	6,100	1,591.000	9,705,100
トヨタ紡織	34,500	2,762.000	95,289,000
ユニプレス	15,100	1,192.000	17,999,200
豊田自動織機	60,200	10,560.000	635,712,000
モリタホールディングス	14,600	1,631.000	23,812,600
三櫻工業	14,000	983.000	13,762,000
デンソー	169,900	10,075.000	1,711,742,500

東海理化電機製作所	22,700	2,348.000	53,299,600
川崎重工業	62,100	4,038.000	250,759,800
名村造船所	14,800	1,012.000	14,977,600
日本車輛製造	5,000	2,084.000	10,420,000
三菱ロジスネクスト	14,000	1,303.000	18,242,000
日産自動車	1,171,200	629.300	737,036,160
いすゞ自動車	239,100	1,869.500	446,997,450
トヨタ自動車	4,527,000	2,595.000	11,747,565,000
日野自動車	106,900	568.000	60,719,200
三菱自動車工業	322,300	575.700	185,548,110
G M B	1,300	2,003.000	2,603,900
武蔵精密工業	19,800	1,677.000	33,204,600
日産車体	16,000	903.000	14,448,000
新明和工業	25,900	1,420.000	36,778,000
極東開発工業	13,300	1,882.000	25,030,600
トピー工業	7,100	2,440.000	17,324,000
ティラド	3,000	2,188.000	6,564,000
タチエス	13,200	1,797.000	23,720,400
N O K	32,200	2,051.500	66,058,300
フタバ産業	24,000	734.000	17,616,000
K Y B	7,800	4,850.000	37,830,000
大同メタル工業	19,500	548.000	10,686,000
プレス工業	36,200	690.000	24,978,000
ミクニ	10,000	486.000	4,860,000
太平洋工業	18,400	1,472.000	27,084,800
アイシン	63,500	4,901.000	311,213,500
マツダ	272,500	1,633.000	444,992,500
今仙電機製作所	6,300	656.000	4,132,800
本田技研工業	670,000	4,953.000	3,318,510,000
スズキ	151,400	5,880.000	890,232,000
S U B A R U	260,900	2,861.000	746,434,900
安永	4,400	818.000	3,599,200
ヤマハ発動機	118,500	3,825.000	453,262,500
エクセディ	13,000	2,707.000	35,191,000
豊田合成	23,800	3,198.000	76,112,400
愛三工業	14,000	1,320.000	18,480,000
日本プラスト	11,000	497.000	5,467,000
ヨロズ	9,000	940.000	8,460,000
エフ・シー・シー	14,200	1,952.000	27,718,400
シマノ	33,500	21,195.000	710,032,500
テイ・エス テック	37,500	1,719.000	64,462,500
ジャムコ	3,400	1,666.000	5,664,400
テルモ	253,600	4,284.000	1,086,422,400
日機装	19,100	1,033.000	19,730,300
日本エム・ディ・エム	5,400	757.000	4,087,800
島津製作所	100,200	4,103.000	411,120,600
長野計器	6,200	2,720.000	16,864,000
ブイ・テクノロジー	4,400	2,303.000	10,133,200

東京計器	6,900	1,517.000	10,467,300
愛知時計電機	3,800	1,743.000	6,623,400
インターアクション	4,500	1,054.000	4,743,000
オーバル	7,300	435.000	3,175,500
東京精密	18,100	7,820.000	141,542,000
マニー	33,200	1,861.000	61,785,200
ニコン	119,200	1,559.500	185,892,400
トプコン	43,500	1,677.000	72,949,500
オリンパス	507,600	1,950.000	989,820,000
理研計器	5,100	5,380.000	27,438,000
タムロン	5,400	4,430.000	23,922,000
H O Y A	174,600	16,080.000	2,807,568,000
ノーリツ鋼機	7,900	3,345.000	26,425,500
A & D ホロンホールディングス	11,900	1,693.000	20,146,700
朝日インテック	92,100	3,007.000	276,944,700
シチズン時計	78,100	915.000	71,461,500
リズム	2,400	1,697.000	4,072,800
メニコン	28,400	1,973.000	56,033,200
松風	4,000	2,182.000	8,728,000
セイコーグループ	12,800	2,637.000	33,753,600
ニプロ	69,000	1,218.000	84,042,000
スノーピーク	12,300	1,400.000	17,220,000
パラマウントベッドホールディングス	18,900	2,395.000	45,265,500
トランザクション	5,800	1,891.000	10,967,800
ニホンフラッシュ	8,600	903.000	7,765,800
前田工織	7,000	3,075.000	21,525,000
永大産業	17,800	225.000	4,005,000
アートネイチャー	9,800	780.000	7,644,000
バンダイナムコホールディングス	225,900	3,250.000	734,175,000
S H O E I	18,700	2,412.000	45,104,400
フランスベッドホールディングス	10,500	1,211.000	12,715,500
パイロットコーポレーション	12,400	4,738.000	58,751,200
萩原工業	6,300	1,723.000	10,854,900
フジシールインターナショナル	16,700	1,783.000	29,776,100
タカラトミー	37,500	2,358.000	88,425,000
広済堂ホールディングス	4,000	2,608.000	10,432,000
プロネクサス	7,700	1,111.000	8,554,700
凸版印刷	101,200	3,589.000	363,206,800
大日本印刷	90,200	3,942.000	355,568,400
共同印刷	2,800	3,240.000	9,072,000
N I S S H A	15,100	1,690.000	25,519,000
T A K A R A & C O M P A N Y	5,700	2,466.000	14,056,200
アシックス	70,200	5,355.000	375,921,000
ツツミ	2,000	2,470.000	4,940,000
ローランド	6,200	3,820.000	23,684,000
小松ウオール工業	3,300	2,989.000	9,863,700
ヤマハ	51,900	4,286.000	222,443,400
河合楽器製作所	2,400	3,395.000	8,148,000

クリナップ	10,500	726.000	7,623,000
ビジョン	53,000	1,673.500	88,695,500
キングジム	9,000	877.000	7,893,000
リンテック	16,300	2,444.500	39,845,350
イトーキ	17,100	1,444.000	24,692,400
任天堂	520,600	6,370.000	3,316,222,000
三菱鉛筆	11,800	1,895.000	22,361,000
タカラスタANDARD	15,200	1,850.000	28,120,000
コクヨ	37,200	2,372.500	88,257,000
グローブライト	6,800	2,052.000	13,953,600
オカムラ	24,900	2,259.000	56,249,100
美津濃	8,300	4,510.000	37,433,000
東京電力ホールディングス	743,400	634.500	471,687,300
中部電力	303,000	1,951.000	591,153,000
関西電力	318,100	2,230.500	709,522,050
中国電力	131,300	967.800	127,072,140
北陸電力	78,100	826.300	64,534,030
東北電力	201,400	1,034.000	208,247,600
四国電力	70,100	1,044.000	73,184,400
九州電力	189,200	1,007.500	190,619,000
北海道電力	79,500	658.400	52,342,800
沖縄電力	19,200	1,143.000	21,945,600
電源開発	61,900	2,360.000	146,084,000
エフオン	6,500	515.000	3,347,500
イーレックス	15,100	840.000	12,684,000
レノバ	22,200	1,346.000	29,881,200
東京瓦斯	174,200	3,398.000	591,931,600
大阪瓦斯	166,700	2,438.500	406,497,950
東邦瓦斯	32,400	2,633.000	85,309,200
北海道瓦斯	5,100	2,367.000	12,071,700
広島ガス	19,100	397.000	7,582,700
西部ガスホールディングス	7,800	2,053.000	16,013,400
静岡ガス	18,000	1,028.000	18,504,000
メタウォーター	9,800	1,916.000	18,776,800
SBSホールディングス	7,200	2,903.000	20,901,600
東武鉄道	90,400	3,993.000	360,967,200
相鉄ホールディングス	27,300	2,848.000	77,750,400
東急	230,700	1,810.500	417,682,350
京浜急行電鉄	93,400	1,361.500	127,164,100
小田急電鉄	124,800	2,228.000	278,054,400
京王電鉄	43,600	5,165.000	225,194,000
京成電鉄	53,100	5,570.000	295,767,000
富士急行	10,200	5,070.000	51,714,000
東日本旅客鉄道	139,900	8,357.000	1,169,144,300
西日本旅客鉄道	105,500	6,344.000	669,292,000
東海旅客鉄道	63,500	18,810.000	1,194,435,000
西武ホールディングス	99,900	1,508.000	150,649,200
鴻池運輸	14,000	2,042.000	28,588,000

西日本鉄道	21,600	2,582.500	55,782,000
ハマキョウレックス	6,300	4,200.000	26,460,000
サカイ引越センター	3,900	5,330.000	20,787,000
近鉄グループホールディングス	82,100	4,461.000	366,248,100
阪急阪神ホールディングス	109,500	5,370.000	588,015,000
南海電気鉄道	39,300	3,092.000	121,515,600
京阪ホールディングス	45,400	4,060.000	184,324,000
神戸電鉄	2,800	3,055.000	8,554,000
名古屋鉄道	90,800	2,376.000	215,740,800
山陽電気鉄道	6,700	2,241.000	15,014,700
アルプス物流	6,700	1,610.000	10,787,000
ヤマトホールディングス	105,400	2,550.000	268,770,000
山九	20,900	5,176.000	108,178,400
丸全昭和運輸	5,000	3,935.000	19,675,000
センコーグループホールディングス	42,900	1,066.000	45,731,400
トナミホールディングス	1,900	4,810.000	9,139,000
ニッコンホールディングス	26,100	3,330.000	86,913,000
福山通運	6,200	3,580.000	22,196,000
セイノーホールディングス	47,100	2,161.000	101,783,100
神奈川中央交通	2,600	3,320.000	8,632,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	20,000	2,140.000	42,800,000
C & F ロジホールディングス	8,300	1,377.000	11,429,100
九州旅客鉄道	58,100	3,159.000	183,537,900
S Gホールディングス	157,800	2,033.000	320,807,400
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	28,300	7,432.000	210,325,600
日本郵船	219,900	3,905.000	858,709,500
商船三井	144,500	4,170.000	602,565,000
川崎汽船	61,800	5,176.000	319,876,800
N S ユナイテッド海運	4,600	4,080.000	18,768,000
明治海運	7,400	791.000	5,853,400
飯野海運	30,600	1,059.000	32,405,400
乾汽船	11,600	1,230.000	14,268,000
日本航空	201,900	2,977.500	601,157,250
A N Aホールディングス	224,600	3,290.000	738,934,000
トランコム	2,400	7,700.000	18,480,000
日新	6,500	2,765.000	17,972,500
三菱倉庫	17,400	3,858.000	67,129,200
三井倉庫ホールディングス	7,500	4,300.000	32,250,000
住友倉庫	21,500	2,555.000	54,932,500
澁澤倉庫	3,300	3,300.000	10,890,000
東陽倉庫	18,700	286.000	5,348,200
日本トランスシティ	16,800	665.000	11,172,000
川西倉庫	5,200	1,068.000	5,553,600
安田倉庫	6,500	1,070.000	6,955,000
上組	39,000	3,150.000	122,850,000
キムラユニティー	4,300	1,409.000	6,058,700
キューソー流通システム	6,300	956.000	6,022,800

エーアイティー	5,400	1,776.000	9,590,400
内外トランスライン	3,500	2,560.000	8,960,000
日本コンセプト	3,300	1,814.000	5,986,200
NEC ネットズエスアイ	27,300	2,000.000	54,600,000
クロスキャット	5,200	1,010.000	5,252,000
システナ	138,200	282.000	38,972,400
デジタルアーツ	5,200	4,785.000	24,882,000
日鉄ソリューションズ	14,000	4,185.000	58,590,000
キューブシステム	5,600	1,182.000	6,619,200
コア	4,400	1,751.000	7,704,400
手間いらず	1,500	3,050.000	4,575,000
ラクーンホールディングス	8,100	760.000	6,156,000
ソリトンシステムズ	4,800	1,173.000	5,630,400
ソフトクリエイティブホールディングス	7,100	1,706.000	12,112,600
T I S	90,400	3,382.000	305,732,800
グリー	23,300	595.000	13,863,500
コーエーテックモホールディングス	51,800	2,210.500	114,503,900
三菱総合研究所	3,900	5,040.000	19,656,000
ファインデックス	8,200	730.000	5,986,000
ブレインパッド	6,600	893.000	5,893,800
K L a b	18,400	280.000	5,152,000
ポールトゥウィンホールディングス	15,000	680.000	10,200,000
ネクソン	184,500	2,896.500	534,404,250
アイスタイル	26,400	467.000	12,328,800
エムアップホールディングス	10,800	1,332.000	14,385,600
エイチーム	6,700	609.000	4,080,300
エニグモ	12,700	400.000	5,080,000
コロブラ	31,500	645.000	20,317,500
ブロードリーフ	42,900	558.000	23,938,200
クロス・マーケティンググループ	5,000	719.000	3,595,000
デジタルハーツホールディングス	5,700	1,120.000	6,384,000
システム情報	7,800	772.000	6,021,600
メディアドゥ	3,700	1,163.000	4,303,100
じげん	24,900	593.000	14,765,700
フィックスターズ	9,800	1,203.000	11,789,400
C A R T A H O L D I N G S	4,400	1,229.000	5,407,600
オブティム	7,200	868.000	6,249,600
セレス	3,800	979.000	3,720,200
S H I F T	5,500	27,780.000	152,790,000
ティーガイア	9,000	1,815.000	16,335,000
テクマトリックス	15,200	1,613.000	24,517,600
プロシップ	4,300	1,257.000	5,405,100
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	22,600	2,356.500	53,256,900
G M O ペイメントゲートウェイ	16,500	8,823.000	145,579,500
システムリサーチ	2,800	2,616.000	7,324,800
インターネットイニシアティブ	45,100	2,559.500	115,433,450
さくらインターネット	9,600	1,218.000	11,692,800
ヴァンクス	3,200	1,286.000	4,115,200

GMOグローバルサイン・ホールディングス	2,700	2,816.000	7,603,200
SRAホールディングス	4,400	3,580.000	15,752,000
朝日ネット	9,600	633.000	6,076,800
eBASE	12,200	689.000	8,405,800
アバントグループ	10,700	1,377.000	14,733,900
アドソル日進	3,800	1,753.000	6,661,400
フリービット	5,100	1,431.000	7,298,100
コムチュア	11,000	2,423.000	26,653,000
アステリア	7,200	807.000	5,810,400
アイル	4,000	3,300.000	13,200,000
マークラインズ	4,700	3,080.000	14,476,000
メディカル・データ・ビジョン	12,600	787.000	9,916,200
gumi	13,100	466.000	6,104,600
テラスカイ	3,900	2,072.000	8,080,800
デジタル・インフォメーション・テクノロ ジー	5,200	1,846.000	9,599,200
PR TIMES	2,700	1,767.000	4,770,900
ラクス	39,000	2,275.500	88,744,500
ダブルスタンダード	3,700	1,443.000	5,339,100
オーブドア	6,300	1,000.000	6,300,000
アカツキ	4,400	2,170.000	9,548,000
UBICOMホールディングス	3,100	1,423.000	4,411,300
カナミックネットワーク	12,600	500.000	6,300,000
チェンジホールディングス	20,300	1,937.000	39,321,100
オークネット	4,500	1,860.000	8,370,000
マクロミル	17,000	773.000	13,141,000
オロ	3,700	2,007.000	7,425,900
ユーザーローカル	3,200	1,847.000	5,910,400
マネーフォワード	18,500	5,019.000	92,851,500
SUN ASTERISK	6,200	1,438.000	8,915,600
プラスアルファ・コンサルティング	4,900	2,709.000	13,274,100
電算システムホールディングス	4,200	2,957.000	12,419,400
APPIER GROUP	28,400	1,672.000	47,484,800
プロトコーポレーション	10,500	1,214.000	12,747,000
野村総合研究所	164,700	4,154.000	684,163,800
サイバネットシステム	8,600	758.000	6,518,800
日本システム技術	2,800	2,188.000	6,126,400
インテージホールディングス	9,500	2,200.000	20,900,000
インフォコム	10,600	2,859.000	30,305,400
シンプレクス・ホールディングス	14,200	2,840.000	40,328,000
HEROZ	3,000	1,500.000	4,500,000
ラクスル	20,100	1,531.000	30,773,100
メルカリ	50,100	3,045.000	152,554,500
IPS	3,000	2,314.000	6,942,000
システムサポート	3,400	2,107.000	7,163,800
イーソル	7,500	747.000	5,602,500
ウイングアーク1st	8,700	2,537.000	22,071,900

ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,600	1,396.000	3,629,600
サーバーワークス	1,900	3,760.000	7,144,000
Sansan	27,300	1,387.000	37,865,100
ギフトィ	7,600	1,472.000	11,187,200
メドレー	11,100	5,380.000	59,718,000
ベース	3,100	4,385.000	13,593,500
JMDC	13,700	5,275.000	72,267,500
フォーカスシステムズ	6,800	989.000	6,725,200
クレスコ	7,000	1,855.000	12,985,000
フジ・メディア・ホールディングス	79,500	1,573.500	125,093,250
オービック	27,600	24,945.000	688,482,000
ジャストシステム	11,900	3,034.000	36,104,600
TDCソフト	7,200	1,740.000	12,528,000
Zホールディングス	1,177,500	429.500	505,736,250
トレンドマイクロ	39,100	6,076.000	237,571,600
IDホールディングス	6,100	1,422.000	8,674,200
日本オラクル	15,900	10,375.000	164,962,500
アルファシステムズ	3,000	3,105.000	9,315,000
フューチャー	18,500	1,491.000	27,583,500
CAC HOLDINGS	5,300	1,748.000	9,264,400
SBテクノロジー	3,700	2,339.000	8,654,300
オービックビジネスコンサルタント	16,300	6,280.000	102,364,000
伊藤忠テクノソリューションズ	44,400	4,320.000	191,808,000
アイティフォー	11,500	1,069.000	12,293,500
東計電算	1,400	6,440.000	9,016,000
大塚商会	41,200	6,439.000	265,286,800
サイボウズ	11,600	2,089.000	24,232,400
電通国際情報サービス	10,000	5,770.000	57,700,000
ACCESS	10,400	828.000	8,611,200
デジタルガレージ	14,700	3,570.000	52,479,000
イーエムシステムズ	14,500	759.000	11,005,500
ウェザーニューズ	2,500	6,400.000	16,000,000
CIJ	14,700	563.000	8,276,100
ビジネスエンジニアリング	1,500	3,335.000	5,002,500
WOWOW	7,000	1,165.000	8,155,000
スカラ	8,700	754.000	6,559,800
ANYCOLOR	3,000	3,420.000	10,260,000
IMAGICA GROUP	8,000	589.000	4,712,000
ネットワンシステムズ	30,900	2,734.000	84,480,600
アルゴグラフィックス	7,500	3,345.000	25,087,500
マーベラス	14,200	691.000	9,812,200
エイベックス	14,200	1,465.000	20,803,000
BIPROGY	30,500	3,893.000	118,736,500
都築電気	4,500	2,406.000	10,827,000
TBSホールディングス	42,300	2,629.500	111,227,850
日本テレビホールディングス	72,900	1,371.500	99,982,350
朝日放送グループホールディングス	9,600	682.000	6,547,200



テレビ朝日ホールディングス	19,900	1,714.000	34,108,600
スカパーJ S A Tホールディングス	73,700	718.000	52,916,600
テレビ東京ホールディングス	6,000	3,065.000	18,390,000
日本BS放送	6,500	913.000	5,934,500
ビジョン	12,600	1,543.000	19,441,800
USEN-NEXT HOLDINGS	9,300	3,435.000	31,945,500
日本通信	78,500	224.000	17,584,000
日本電信電話	26,489,800	171.100	4,532,404,780
KDDI	639,000	4,417.000	2,822,463,000
ソフトバンク	1,329,400	1,714.500	2,279,256,300
光通信	9,700	23,870.000	231,539,000
エムティーアイ	8,200	610.000	5,002,000
GMOインターネットグループ	30,600	2,386.500	73,026,900
ファイバーゲート	5,000	1,499.000	7,495,000
KADOKAWA	43,600	3,236.000	141,089,600
学研ホールディングス	14,400	870.000	12,528,000
ゼンリン	14,500	921.000	13,354,500
アイネット	5,700	1,788.000	10,191,600
松竹	4,700	10,860.000	51,042,000
東宝	51,700	5,668.000	293,035,600
東映	2,300	19,190.000	44,137,000
NTTデータグループ	259,000	1,997.000	517,223,000
ピー・シー・エー	5,200	1,253.000	6,515,600
ビジネスブレイン太田昭和	3,900	2,113.000	8,240,700
D T S	17,200	3,240.000	55,728,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	41,600	5,318.000	221,228,800
シーイーシー	11,700	1,649.000	19,293,300
カプコン	82,200	6,067.000	498,707,400
アイ・エス・ピー	4,600	1,418.000	6,522,800
ジャステック	5,500	1,472.000	8,096,000
S C S K	67,200	2,552.500	171,528,000
NSW	3,300	2,976.000	9,820,800
アイネス	6,300	1,660.000	10,458,000
T K C	12,700	3,640.000	46,228,000
富士ソフト	17,200	4,460.000	76,712,000
NSD	29,000	2,465.000	71,485,000
コナミグループ	35,400	8,355.000	295,767,000
福井コンピュータホールディングス	6,500	2,742.000	17,823,000
J B C Cホールディングス	6,200	2,664.000	16,516,800
ミロク情報サービス	7,900	1,595.000	12,600,500
ソフトバンクグループ	407,900	6,611.000	2,696,626,900
高千穂交易	2,700	3,170.000	8,559,000
伊藤忠食品	2,000	6,270.000	12,540,000
エレマテック	8,000	1,904.000	15,232,000
あらた	6,600	5,630.000	37,158,000
トーメンデバイス	1,400	5,020.000	7,028,000
東京エレクトロン デバイス	3,200	10,310.000	32,992,000
円谷フィールズホールディングス	15,100	2,177.000	32,872,700

双日	86,800	3,282.000	284,877,600
アルフレッサ ホールディングス	87,600	2,508.000	219,700,800
横浜冷凍	24,300	1,346.000	32,707,800
ラサ商事	5,000	1,582.000	7,910,000
アルコニックス	12,000	1,397.000	16,764,000
神戸物産	67,500	3,530.000	238,275,000
あい ホールディングス	13,800	2,568.000	35,438,400
ダイワボウホールディングス	35,700	2,885.500	103,012,350
マクニカホールディングス	20,600	6,800.000	140,080,000
ラクト・ジャパン	3,800	2,070.000	7,866,000
グリムス	3,800	2,295.000	8,721,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	13,400	970.000	12,998,000
八洲電機	7,700	1,306.000	10,056,200
メディアスホールディングス	7,000	740.000	5,180,000
レスターホールディングス	8,000	2,465.000	19,720,000
ジューテックホールディングス	3,000	1,226.000	3,678,000
大光	8,900	638.000	5,678,200
T O K A Iホールディングス	42,300	930.000	39,339,000
三洋貿易	10,100	1,379.000	13,927,900
ビューティガレージ	1,500	5,130.000	7,695,000
ウイン・パートナーズ	6,800	1,105.000	7,514,000
シップヘルスケアホールディングス	31,500	2,378.500	74,922,750
コメダホールディングス	21,600	2,967.000	64,087,200
フルサト・マルカホールディングス	8,300	2,783.000	23,098,900
ヤマエグループホールディングス	5,000	4,050.000	20,250,000
小野建	8,700	1,722.000	14,981,400
南陽	2,500	2,207.000	5,517,500
佐鳥電機	4,600	1,791.000	8,238,600
伯東	5,000	5,400.000	27,000,000
コンドーテック	7,600	1,169.000	8,884,400
ナガイレーベン	11,000	2,247.000	24,717,000
三菱食品	8,300	4,015.000	33,324,500
松田産業	6,800	2,257.000	15,347,600
第一興商	33,800	2,692.000	90,989,600
メディバルホールディングス	83,300	2,532.000	210,915,600
S P K	4,400	1,990.000	8,756,000
萩原電気ホールディングス	3,700	4,380.000	16,206,000
アズワン	12,400	5,780.000	71,672,000
スズデン	3,800	2,276.000	8,648,800
尾家産業	2,500	1,997.000	4,992,500
シモジマ	6,700	1,195.000	8,006,500
ドウシシャ	9,000	2,331.000	20,979,000
高速	4,700	2,049.000	9,630,300
たけびし	3,700	1,921.000	7,107,700
リックス	2,000	3,055.000	6,110,000
丸文	8,300	1,193.000	9,901,900
ハピネット	7,900	2,644.000	20,887,600
日本ライフライン	25,700	1,202.000	30,891,400

タカショー	9,000	651.000	5,859,000
I D O M	26,800	767.000	20,555,600
進和	5,800	2,352.000	13,641,600
ダイترون	3,600	3,065.000	11,034,000
シークス	12,300	1,530.000	18,819,000
オーハシテクニカ	4,700	1,708.000	8,027,600
白銅	3,400	2,370.000	8,058,000
伊藤忠商事	537,300	5,701.000	3,063,147,300
丸紅	680,400	2,460.500	1,674,124,200
長瀬産業	39,500	2,502.000	98,829,000
蝶理	4,800	2,902.000	13,929,600
豊田通商	76,300	8,834.000	674,034,200
三共生興	14,600	758.000	11,066,800
兼松	33,400	2,138.000	71,409,200
三井物産	619,000	5,629.000	3,484,351,000
日本紙パルプ商事	4,600	4,890.000	22,494,000
カメイ	9,500	1,500.000	14,250,000
スターゼン	6,600	2,580.000	17,028,000
山善	22,400	1,114.000	24,953,600
椿本興業	1,600	5,020.000	8,032,000
住友商事	527,700	3,096.000	1,633,759,200
内田洋行	3,500	6,780.000	23,730,000
三菱商事	531,800	7,486.000	3,981,054,800
第一実業	3,100	5,590.000	17,329,000
キャノンマーケティングジャパン	20,200	3,852.000	77,810,400
西華産業	4,000	2,163.000	8,652,000
佐藤商事	6,300	1,539.000	9,695,700
菱洋エレクトロ	7,500	3,325.000	24,937,500
東京産業	8,900	844.000	7,511,600
ユアサ商事	7,500	4,285.000	32,137,500
神鋼商事	2,300	5,870.000	13,501,000
阪和興業	15,500	4,855.000	75,252,500
正栄食品工業	5,800	4,545.000	26,361,000
カナデン	6,700	1,403.000	9,400,100
R Y O D E N	7,100	2,344.000	16,642,400
岩谷産業	19,900	7,604.000	151,319,600
ナイス	2,600	1,509.000	3,923,400
極東貿易	5,900	1,936.000	11,422,400
アステナホールディングス	18,300	468.000	8,564,400
三愛オブリ	22,900	1,732.000	39,662,800
稲畑産業	16,900	3,235.000	54,671,500
G S I クレオス	5,400	2,245.000	12,123,000
明和産業	12,500	673.000	8,412,500
ワキタ	16,100	1,408.000	22,668,800
東邦ホールディングス	21,900	2,873.500	62,929,650
サンゲツ	22,000	3,010.000	66,220,000
ミツウロコグループホールディングス	11,900	1,340.000	15,946,000
シナネンホールディングス	3,000	4,110.000	12,330,000

伊藤忠エネクス	21,100	1,498.000	31,607,800
サンリオ	24,800	7,583.000	188,058,400
サンワ テクノス	4,600	2,223.000	10,225,800
リョーサン	9,300	4,465.000	41,524,500
新光商事	12,300	1,222.000	15,030,600
トーホー	4,000	3,830.000	15,320,000
三信電気	3,900	2,214.000	8,634,600
東陽テクニカ	9,200	1,330.000	12,236,000
モスフードサービス	12,600	3,340.000	42,084,000
加賀電子	7,000	6,660.000	46,620,000
ソーダニッカ	6,200	1,004.000	6,224,800
立花エレテック	6,400	2,766.000	17,702,400
PALTA C	13,800	4,859.000	67,054,200
三谷産業	18,600	332.000	6,175,200
太平洋興発	6,000	788.000	4,728,000
西本Wismettacホールディングス	2,300	4,535.000	10,430,500
KPPグループホールディングス	21,100	664.000	14,010,400
ヤマタネ	4,500	2,064.000	9,288,000
泉州電業	4,300	3,800.000	16,340,000
トラスコ中山	18,200	2,604.000	47,392,800
オートバックスセブン	30,100	1,588.000	47,798,800
モリト	7,300	1,301.000	9,497,300
加藤産業	10,600	4,200.000	44,520,000
イエローハット	15,000	1,905.000	28,575,000
JKホールディングス	7,200	996.000	7,171,200
日伝	5,200	2,520.000	13,104,000
杉本商事	3,900	2,268.000	8,845,200
因幡電機産業	21,900	3,155.000	69,094,500
東テク	3,000	5,180.000	15,540,000
ミスミグループ本社	131,500	2,446.500	321,714,750
タキヒヨー	2,900	1,180.000	3,422,000
スズケン	25,600	4,440.000	113,664,000
ジェコス	6,100	957.000	5,837,700
グローセル	12,000	431.000	5,172,000
ローソン	21,700	7,010.000	152,117,000
サンエー	6,600	4,860.000	32,076,000
カワチ薬品	7,000	2,297.000	16,079,000
エービーシー・マート	37,800	2,688.500	101,625,300
ハードオフコーポレーション	3,800	1,573.000	5,977,400
アスクル	18,200	1,971.000	35,872,200
ゲオホールディングス	9,000	2,574.000	23,166,000
アダストリア	10,600	2,862.000	30,337,200
くら寿司	10,300	3,425.000	35,277,500
キャンドウ	4,200	2,724.000	11,440,800
パルグループホールディングス	17,000	2,043.000	34,731,000
エディオン	34,700	1,494.000	51,841,800
サーラコーポレーション	18,900	763.000	14,420,700
ハローズ	4,000	4,110.000	16,440,000

フジオフードグループ本社	10,600	1,399.000	14,829,400
あみやき亭	2,400	3,585.000	8,604,000
大黒天物産	2,700	6,840.000	18,468,000
ハニーズホールディングス	7,200	1,669.000	12,016,800
アルペン	7,300	1,927.000	14,067,100
クオールホールディングス	12,200	1,913.000	23,338,600
ジーンズホールディングス	5,300	3,360.000	17,808,000
ビックカメラ	46,200	1,091.000	50,404,200
D C Mホールディングス	51,000	1,263.000	64,413,000
MonotaRO	123,700	1,602.500	198,229,250
DDグループ	4,100	1,644.000	6,740,400
J . フロント リテイリング	108,700	1,607.000	174,680,900
ドトール・日レスホールディングス	15,400	2,381.000	36,667,400
マツキヨココカラ&カンパニー	52,900	8,578.000	453,776,200
ブロンコピラー	5,200	3,090.000	16,068,000
Z O Z O	57,700	2,788.500	160,896,450
トレジャー・ファクトリー	4,200	1,391.000	5,842,200
物語コーポレーション	14,600	4,630.000	67,598,000
三越伊勢丹ホールディングス	147,000	1,757.500	258,352,500
ウエルシアホールディングス	45,400	2,665.000	120,991,000
クリエイティブSDホールディングス	14,100	3,660.000	51,606,000
チムニー	5,400	1,546.000	8,348,400
シュッピン	7,200	1,158.000	8,337,600
オイシックス・ラ・大地	11,800	1,680.000	19,824,000
ネクステージ	20,000	2,348.000	46,960,000
ジョイフル本田	25,000	1,749.000	43,725,000
鳥貴族ホールディングス	3,700	3,165.000	11,710,500
ホットランド	7,100	1,705.000	12,105,500
すかいらくホールディングス	119,200	2,043.000	243,525,600
S F Pホールディングス	5,100	2,359.000	12,030,900
綿半ホールディングス	7,100	1,367.000	9,705,700
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	1,126.000	32,991,800
B E E N O S	3,800	1,648.000	6,262,400
あさひ	7,600	1,289.000	9,796,400
日本調剤	6,400	1,430.000	9,152,000
コスモス薬品	8,700	16,745.000	145,681,500
セブン&アイ・ホールディングス	300,700	5,973.000	1,796,081,100
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	65,800	1,212.000	79,749,600
ツルハホールディングス	18,300	10,600.000	193,980,000
サンマルクホールディングス	7,300	1,887.000	13,775,100
フェリシモ	4,000	1,004.000	4,016,000
トリドールホールディングス	21,600	3,910.000	84,456,000
T O K Y O B A S E	10,400	303.000	3,151,200
J Mホールディングス	6,900	1,912.000	13,192,800
アレンザホールディングス	7,300	1,011.000	7,380,300
串カツ田中ホールディングス	3,800	1,605.000	6,099,000

クスリのアオキホールディングス	7,800	9,057.000	70,644,600
力の源ホールディングス	3,800	2,231.000	8,477,800
FOOD & LIFE COMPANIES	46,600	2,815.000	131,179,000
ノジマ	28,300	1,299.000	36,761,700
カップ・クリエイト	13,700	1,612.000	22,084,400
良品計画	95,400	1,889.500	180,258,300
アドヴァングループ	10,500	1,020.000	10,710,000
アルビス	3,100	2,442.000	7,570,200
G-7ホールディングス	11,200	1,267.000	14,190,400
イオン北海道	15,200	852.000	12,950,400
コジマ	15,600	642.000	10,015,200
コーナン商事	11,800	3,665.000	43,247,000
エコス	3,700	2,037.000	7,536,900
ワタミ	11,300	1,177.000	13,300,100
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	176,200	3,049.000	537,233,800
西松屋チェーン	19,300	1,649.000	31,825,700
ゼンショーホールディングス	47,800	6,780.000	324,084,000
サイゼリヤ	13,000	4,760.000	61,880,000
V Tホールディングス	34,500	522.000	18,009,000
フジ・コーポレーション	5,100	2,052.000	10,465,200
ユナイテッドアローズ	9,400	2,018.000	18,969,200
ハイデイ日高	13,100	2,909.000	38,107,900
コロワイド	40,300	2,594.500	104,558,350
壱番屋	6,800	5,590.000	38,012,000
スギホールディングス	17,600	6,347.000	111,707,200
薬王堂ホールディングス	5,200	2,661.000	13,837,200
スクロール	13,200	1,015.000	13,398,000
ヨンドシーホールディングス	7,700	1,828.000	14,075,600
木曽路	12,800	2,620.000	33,536,000
S R Sホールディングス	15,700	1,086.000	17,050,200
千趣会	18,000	410.000	7,380,000
リテールパートナーズ	12,900	1,699.000	21,917,100
ケーヨー	14,700	879.000	12,921,300
上新電機	7,600	2,392.000	18,179,200
日本瓦斯	46,500	2,304.500	107,159,250
ロイヤルホールディングス	16,500	2,669.000	44,038,500
いなげや	9,300	1,537.000	14,294,100
チヨダ	9,500	964.000	9,158,000
ライフコーポレーション	7,700	3,660.000	28,182,000
リンガーハット	11,100	2,331.000	25,874,100
MrMaxHD	13,200	622.000	8,210,400
AOKIホールディングス	16,900	1,062.000	17,947,800
オークワ	14,700	908.000	13,347,600
コメリ	13,400	3,175.000	42,545,000
青山商事	18,900	1,690.000	31,941,000
しまむら	10,200	14,855.000	151,521,000

高島屋	66,000	2,186.000	144,276,000
松屋	15,300	1,084.000	16,585,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	42,500	1,891.000	80,367,500
近鉄百貨店	4,800	2,998.000	14,390,400
丸井グループ	64,400	2,516.500	162,062,600
アクシアル リテイリング	5,900	3,750.000	22,125,000
イオン	295,700	2,984.500	882,516,650
イズミ	13,200	3,859.000	50,938,800
平和堂	14,800	2,501.000	37,014,800
フジ	13,200	1,807.000	23,852,400
ヤオコー	9,800	7,819.000	76,626,200
ゼビオホールディングス	12,200	1,020.000	12,444,000
ケーズホールディングス	61,500	1,383.000	85,054,500
OLYMPICグループ	5,200	524.000	2,724,800
シルバーライフ	2,500	1,176.000	2,940,000
Genky DrugStores	3,900	5,080.000	19,812,000
ブックオフグループホールディングス	5,300	1,243.000	6,587,900
ギフトホールディングス	3,900	2,693.000	10,502,700
アインホールディングス	12,100	4,526.000	54,764,600
元気寿司	3,000	5,190.000	15,570,000
ヤマダホールディングス	357,300	468.600	167,430,780
アーケランズ	27,138	1,630.000	44,234,940
ニトリホールディングス	35,300	17,365.000	612,984,500
グルメ杵屋	8,300	1,144.000	9,495,200
ケーユーホールディングス	5,900	1,206.000	7,115,400
吉野家ホールディングス	34,000	2,897.500	98,515,000
松屋フーズホールディングス	4,100	4,215.000	17,281,500
サガミホールディングス	13,800	1,422.000	19,623,600
関西フードマーケット	8,500	1,488.000	12,648,000
王将フードサービス	5,800	6,990.000	40,542,000
ミニストップ	6,700	1,459.000	9,775,300
アークス	16,100	2,688.000	43,276,800
パローホールディングス	16,900	2,175.000	36,757,500
ベルク	4,300	6,780.000	29,154,000
大 庄	6,900	1,165.000	8,038,500
ファーストリテイリング	39,200	33,560.000	1,315,552,000
サンドラッグ	33,100	4,303.000	142,429,300
サックスパー ホールディングス	9,300	1,003.000	9,327,900
やまや	3,000	3,090.000	9,270,000
ベルーナ	21,200	755.000	16,006,000
いよぎんホールディングス	97,100	1,137.000	110,402,700
しずおかフィナンシャルグループ	180,800	1,277.000	230,881,600
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	68,300	1,125.500	76,871,650
楽天銀行	28,600	1,935.000	55,341,000
島根銀行	6,400	550.000	3,520,000
じもとホールディングス	11,600	435.000	5,046,000
めぶきフィナンシャルグループ	403,700	427.700	172,662,490
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10,500	4,495.000	47,197,500

九州フィナンシャルグループ	142,300	788.900	112,260,470
ゆうちょ銀行	223,700	1,242.000	277,835,400
富山第一銀行	27,200	1,000.000	27,200,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	436,200	709.900	309,658,380
西日本フィナンシャルホールディングス	50,600	1,672.000	84,603,200
三十三フィナンシャルグループ	7,500	1,899.000	14,242,500
第四北越フィナンシャルグループ	12,600	3,950.000	49,770,000
ひろぎんホールディングス	105,700	958.400	101,302,880
おきなわフィナンシャルグループ	7,800	2,460.000	19,188,000
十六フィナンシャルグループ	10,500	3,970.000	41,685,000
北國フィナンシャルホールディングス	9,100	5,760.000	52,416,000
プロクレアホールディングス	10,100	2,085.000	21,058,500
あいちフィナンシャルグループ	11,400	2,682.000	30,574,800
あおぞら銀行	50,900	3,037.000	154,583,300
三菱UFJフィナンシャル・グループ	5,084,900	1,264.000	6,427,313,600
りそなホールディングス	1,020,000	869.900	887,298,000
三井住友トラスト・ホールディングス	145,800	5,829.000	849,868,200
三井住友フィナンシャルグループ	577,000	7,295.000	4,209,215,000
千葉銀行	226,400	1,144.500	259,114,800
群馬銀行	157,700	734.400	115,814,880
武蔵野銀行	10,200	2,833.000	28,896,600
千葉興業銀行	15,100	890.000	13,439,000
筑波銀行	39,400	276.000	10,874,400
七十七銀行	26,000	3,380.000	87,880,000
秋田銀行	5,800	2,037.000	11,814,600
山形銀行	9,800	1,188.000	11,642,400
岩手銀行	5,800	2,845.000	16,501,000
東邦銀行	66,700	291.000	19,409,700
東北銀行	7,000	1,173.000	8,211,000
ふくおかフィナンシャルグループ	64,800	3,750.000	243,000,000
スルガ銀行	72,600	653.000	47,407,800
八十二銀行	170,800	880.400	150,372,320
山梨中央銀行	9,000	1,704.000	15,336,000
大垣共立銀行	15,400	2,154.000	33,171,600
福井銀行	7,500	1,648.000	12,360,000
清水銀行	3,600	1,650.000	5,940,000
富山銀行	2,200	1,841.000	4,050,200
滋賀銀行	13,600	3,490.000	47,464,000
南都銀行	12,300	2,789.000	34,304,700
百五銀行	76,000	551.000	41,876,000
京都銀行	25,700	8,663.000	222,639,100
紀陽銀行	28,900	1,603.000	46,326,700
ほくほくフィナンシャルグループ	51,400	1,461.500	75,121,100
山陰合同銀行	50,500	992.000	50,096,000
鳥取銀行	4,900	1,370.000	6,713,000
百十四銀行	7,600	2,439.000	18,536,400
四国銀行	13,300	1,012.000	13,459,600
阿波銀行	11,500	2,418.000	27,807,000



大分銀行	5,100	2,727.000	13,907,700
宮崎銀行	5,200	2,874.000	14,944,800
佐賀銀行	5,100	2,061.000	10,511,100
琉球銀行	19,200	1,140.000	21,888,000
セブン銀行	292,900	322.000	94,313,800
みずほフィナンシャルグループ	1,174,200	2,581.500	3,031,197,300
高知銀行	4,700	1,025.000	4,817,500
山口フィナンシャルグループ	84,800	1,321.500	112,063,200
名古屋銀行	5,300	4,825.000	25,572,500
北洋銀行	123,000	360.000	44,280,000
大光銀行	4,200	1,359.000	5,707,800
愛媛銀行	11,600	990.000	11,484,000
トマト銀行	5,400	1,244.000	6,717,600
京葉銀行	37,400	672.000	25,132,800
栃木銀行	39,200	341.000	13,367,200
北日本銀行	3,200	2,352.000	7,526,400
東和銀行	15,200	623.000	9,469,600
大東銀行	7,400	733.000	5,424,200
トモニホールディングス	65,700	454.000	29,827,800
フィデアホールディングス	8,500	1,642.000	13,957,000
池田泉州ホールディングス	106,300	317.000	33,697,100
F P G	27,600	1,440.000	39,744,000
ジャパンインベストメントアドバイザー	6,800	1,632.000	11,097,600
マーキュリアホールディングス	5,700	802.000	4,571,400
S B Iホールディングス	117,400	3,144.000	369,105,600
ジャフコ グループ	27,500	1,899.000	52,222,500
大和証券グループ本社	578,100	865.600	500,403,360
野村ホールディングス	1,461,800	610.600	892,575,080
岡三証券グループ	72,600	644.000	46,754,400
丸三証券	28,000	545.000	15,260,000
東洋証券	29,400	362.000	10,642,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	87,000	472.000	41,064,000
水戸証券	23,800	460.000	10,948,000
いちよし証券	14,800	728.000	10,774,400
松井証券	47,900	841.000	40,283,900
マネックスグループ	87,600	556.000	48,705,600
極東証券	10,900	836.000	9,112,400
岩井コスモホールディングス	9,400	1,799.000	16,910,600
アイザワ証券グループ	12,200	917.000	11,187,400
スパークス・グループ	9,200	1,538.000	14,149,600
かんぽ生命保険	94,900	2,498.500	237,107,650
S O M P Oホールディングス	139,300	6,634.000	924,116,200
アニコム ホールディングス	28,500	676.000	19,266,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	164,900	5,564.000	917,503,600
第一生命ホールディングス	396,700	3,010.000	1,194,067,000
東京海上ホールディングス	802,400	3,419.000	2,743,405,600
T & Dホールディングス	217,900	2,481.000	540,609,900

アドバンスクリエイト	6,300	1,170.000	7,371,000
全国保証	21,400	4,999.000	106,978,600
あんしん保証	1,700	294.000	499,800
ジェイリース	2,400	2,127.000	5,104,800
日本モーゲージサービス	7,500	573.000	4,297,500
アルヒ	11,000	930.000	10,230,000
プレミアグループ	13,900	1,590.000	22,101,000
ネットプロテクションズホールディングス	27,200	394.000	10,716,800
クレディセゾン	51,400	2,371.000	121,869,400
芙蓉総合リース	7,400	12,570.000	93,018,000
みずほリース	11,900	4,860.000	57,834,000
東京センチュリー	15,100	5,906.000	89,180,600
日本証券金融	30,100	1,435.000	43,193,500
アイフル	135,400	356.000	48,202,400
リコーリース	7,600	4,455.000	33,858,000
イオンフィナンシャルサービス	46,500	1,281.000	59,566,500
アコム	148,500	357.600	53,103,600
ジャックス	8,600	5,210.000	44,806,000
オリエントコーポレーション	21,300	1,138.000	24,239,400
オリックス	532,400	2,837.000	1,510,418,800
三菱HCキャピタル	314,400	1,010.000	317,544,000
九州リースサービス	5,600	920.000	5,152,000
日本取引所グループ	228,100	2,597.500	592,489,750
イー・ギャランティ	13,700	1,917.000	26,262,900
アサックス	5,400	671.000	3,623,400
NECキャピタルソリューション	3,900	3,325.000	12,967,500
大東建託	29,700	15,660.000	465,102,000
いちご	100,700	315.000	31,720,500
日本駐車場開発	94,300	214.000	20,180,200
スター・マイカ・ホールディングス	11,000	634.000	6,974,000
SREホールディングス	4,200	3,285.000	13,797,000
ヒューリック	188,500	1,310.000	246,935,000
野村不動産ホールディングス	50,500	3,660.000	184,830,000
三重交通グループホールディングス	19,100	603.000	11,517,300
サムティ	10,100	2,331.000	23,543,100
ディア・ライフ	15,000	880.000	13,200,000
地主	7,100	1,870.000	13,277,000
プレサンスコーポレーション	13,900	1,888.000	26,243,200
JPMC	5,600	1,129.000	6,322,400
フージャースホールディングス	13,400	1,130.000	15,142,000
オープンハウスグループ	29,700	5,066.000	150,460,200
東急不動産ホールディングス	243,300	928.600	225,928,380
飯田グループホールディングス	68,900	2,473.000	170,389,700
シーアールイー	5,300	1,526.000	8,087,800
ケイアイスター不動産	4,200	4,840.000	20,328,000
グッドコムアセット	8,900	925.000	8,232,500
ジェイ・エス・ビー	2,200	5,410.000	11,902,000
ロードスターキャピタル	5,900	1,722.000	10,159,800

パーク24	53,500	2,028.500	108,524,750
パラカ	3,900	2,034.000	7,932,600
宮越ホールディングス	4,600	1,024.000	4,710,400
三井不動産	346,400	3,295.000	1,141,388,000
三菱地所	489,700	1,922.000	941,203,400
平和不動産	13,900	4,000.000	55,600,000
東京建物	72,700	2,001.000	145,472,700
京阪神ビルディング	15,700	1,338.000	21,006,600
住友不動産	146,700	3,965.000	581,665,500
テオーシー	17,700	645.000	11,416,500
東京楽天地	1,800	4,105.000	7,389,000
レオパレス21	92,500	335.000	30,987,500
スターツコーポレーション	12,600	2,999.000	37,787,400
フジ住宅	12,700	748.000	9,499,600
空港施設	12,000	591.000	7,092,000
ゴールドクレスト	8,200	2,045.000	16,769,000
エスリード	4,200	3,165.000	13,293,000
日神グループホールディングス	15,200	536.000	8,147,200
日本エスコン	19,600	911.000	17,855,600
MIRARTHホールディングス	47,200	487.000	22,986,400
イオンモール	41,900	1,749.500	73,304,050
毎日コムネット	6,300	762.000	4,800,600
カチタス	22,400	2,213.000	49,571,200
トーセイ	14,600	1,888.000	27,564,800
穴吹興産	2,900	2,038.000	5,910,200
サンフロンティア不動産	15,500	1,471.000	22,800,500
FJネクストホールディングス	9,600	1,072.000	10,291,200
日本空港ビルデング	28,800	6,503.000	187,286,400
LIFULL	32,400	237.000	7,678,800
MIXI	19,100	2,393.000	45,706,300
ジェイエイシーリクルートメント	7,500	2,566.000	19,245,000
日本M&Aセンターホールディングス	145,700	777.700	113,310,890
メンバーズ	3,100	1,251.000	3,878,100
UTグループ	12,300	2,320.000	28,536,000
アイティメディア	3,500	1,182.000	4,137,000
E・Jホールディングス	5,400	1,702.000	9,190,800
オープンアップグループ	25,200	1,920.000	48,384,000
コシダカホールディングス	25,600	1,349.000	34,534,400
パソナグループ	10,200	1,677.000	17,105,400
リンクアンドモチベーション	26,100	457.000	11,927,700
エス・エム・エス	32,300	2,776.000	89,664,800
パーソルホールディングス	93,200	2,507.000	233,652,400
リニカル	6,300	693.000	4,365,900
クックパッド	33,500	160.000	5,360,000
学情	4,500	1,875.000	8,437,500
スタジオアリス	4,800	2,085.000	10,008,000
シミックホールディングス	4,900	1,756.000	8,604,400
NJS	1,500	2,980.000	4,470,000

総合警備保障	157,000	937.700	147,218,900
カカクコム	62,200	1,641.000	102,070,200
アイロムグループ	3,500	1,884.000	6,594,000
セントケア・ホールディング	5,600	813.000	4,552,800
ルネサンス	6,600	927.000	6,118,200
ディップ	14,900	3,630.000	54,087,000
デジタルホールディングス	7,100	1,054.000	7,483,400
新日本科学	9,200	2,063.000	18,979,600
キャリアデザインセンター	2,000	2,060.000	4,120,000
ベネフィット・ワン	39,200	1,170.500	45,883,600
エムスリー	167,400	2,774.000	464,367,600
アウトソーシング	54,400	1,170.500	63,675,200
ウェルネット	8,400	589.000	4,947,600
ワールドホールディングス	3,900	2,342.000	9,133,800
ディー・エヌ・エー	33,800	1,501.000	50,733,800
博報堂D Yホールディングス	107,800	1,346.000	145,098,800
タカミヤ	14,000	508.000	7,112,000
ジャパンベストレスキューシステム	5,700	727.000	4,143,900
ファンコミュニケーションズ	20,300	397.000	8,059,100
ライク	3,800	1,520.000	5,776,000
エスプール	25,600	494.000	12,646,400
WDBホールディングス	4,500	2,093.000	9,418,500
アドウェイズ	12,200	551.000	6,722,200
パリュコマース	7,900	1,265.000	9,993,500
インフォマート	88,100	479.000	42,199,900
J Pホールディングス	27,100	322.000	8,726,200
プレステージ・インターナショナル	35,600	617.000	21,965,200
アミューズ	5,000	1,545.000	7,725,000
ドリームインキュベータ	2,800	3,015.000	8,442,000
クイック	6,600	2,118.000	13,978,800
電通グループ	83,200	4,345.000	361,504,000
ぴあ	3,100	3,750.000	11,625,000
イオンファンタジー	3,900	3,175.000	12,382,500
シーティーエス	10,600	697.000	7,388,200
H . U . グループホールディングス	24,800	2,545.000	63,116,000
アルプス技研	7,800	2,583.000	20,147,400
日本空調サービス	10,200	788.000	8,037,600
オリエンタルランド	448,500	5,192.000	2,328,612,000
ダスキン	18,600	3,371.000	62,700,600
明光ネットワークジャパン	13,800	642.000	8,859,600
ファルコホールディングス	4,300	2,022.000	8,694,600
ラウンドワン	71,300	590.000	42,067,000
リゾートトラスト	33,400	2,345.500	78,339,700
ビー・エム・エル	10,200	2,873.000	29,304,600
リソー教育	41,900	245.000	10,265,500
早稲田アカデミー	5,500	1,502.000	8,261,000
ユー・エス・エス	86,800	2,450.500	212,703,400
東京個別指導学院	12,400	481.000	5,964,400

サイバーエージェント	187,500	846.400	158,700,000
楽天グループ	725,600	576.800	418,526,080
クリーク・アンド・リバー社	5,100	2,141.000	10,919,100
SBIグローバルアセットマネジメント	15,800	567.000	8,958,600
テー・オー・ダブリュー	19,300	308.000	5,944,400
山田コンサルティンググループ	5,000	1,647.000	8,235,000
セントラルスポーツ	3,700	2,449.000	9,061,300
フルキャストホールディングス	8,000	2,023.000	16,184,000
エン・ジャパン	15,200	2,483.000	37,741,600
テクノプロ・ホールディングス	50,100	3,427.000	171,692,700
アイ・アールジャパンホールディングス	4,700	2,308.000	10,847,600
Keepers 技研	5,200	6,340.000	32,968,000
Gunosy	8,100	596.000	4,827,600
イー・ガーディアン	3,700	2,627.000	9,719,900
ジャパンマテリアル	26,000	2,481.000	64,506,000
ベクトル	13,400	1,364.000	18,277,600
チャーム・ケア・コーポレーション	7,400	1,142.000	8,450,800
キャリアリンク	3,200	2,416.000	7,731,200
I B J	7,100	612.000	4,345,200
アサンテ	5,200	1,629.000	8,470,800
バリューHR	8,000	1,259.000	10,072,000
M&Aキャピタルパートナーズ	6,900	2,846.000	19,637,400
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,200	1,001.000	4,204,200
ERIホールディングス	1,900	2,275.000	4,322,500
シグマクシス・ホールディングス	13,000	1,604.000	20,852,000
ウィルグループ	7,000	1,097.000	7,679,000
メドピア	7,700	1,057.000	8,138,900
リクルートホールディングス	627,400	5,150.000	3,231,110,000
エラン	11,500	840.000	9,660,000
日本郵政	1,020,100	1,204.500	1,228,710,450
ベルシステム24ホールディングス	11,600	1,610.000	18,676,000
鎌倉新書	10,600	656.000	6,953,600
エアトリ	6,500	2,217.000	14,410,500
アトラエ	5,900	1,110.000	6,549,000
ストライク	3,800	3,320.000	12,616,000
ソラスト	23,700	647.000	15,333,900
セラク	2,900	1,297.000	3,761,300
インソース	18,500	1,020.000	18,870,000
ベイカレント・コンサルティング	67,100	5,005.000	335,835,500
アイモバイル	4,700	1,294.000	6,081,800
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	30,200	2,298.000	69,399,600
グリーンズ	2,400	1,700.000	4,080,000
ウェルビー	8,300	572.000	4,747,600
エル・ティー・エス	1,300	3,955.000	5,141,500
ミダックホールディングス	5,300	1,884.000	9,985,200
日総工産	6,800	777.000	5,283,600
キュービーネットホールディングス	4,700	1,568.000	7,369,600

R P Aホールディングス	13,400	341.000	4,569,400
マネジメントソリューションズ	3,800	3,865.000	14,687,000
フロンティア・マネジメント	3,300	1,432.000	4,725,600
アンビスホールディングス	9,100	2,972.000	27,045,200
カーブスホールディングス	23,200	724.000	16,796,800
フォーラムエンジニアリング	5,100	1,302.000	6,640,200
FAST FITNESS JAPAN	3,400	1,397.000	4,749,800
ダイレクトマーケティングミックス	10,900	543.000	5,918,700
L I T A L I C O	6,700	2,230.000	14,941,000
リログループ	47,200	1,611.000	76,039,200
東祥	6,900	1,236.000	8,528,400
I D & E ホールディングス	5,100	3,425.000	17,467,500
ビーウィズ	2,400	2,268.000	5,443,200
T R Eホールディングス	17,900	1,233.000	22,070,700
人・夢・技術グループ	3,600	1,730.000	6,228,000
大栄環境	21,700	2,177.000	47,240,900
日本管財ホールディングス	8,400	2,651.000	22,268,400
エイチ・アイ・エス	24,700	1,920.000	47,424,000
ラックランド	4,100	3,020.000	12,382,000
共立メンテナンス	14,600	6,368.000	92,972,800
イチネンホールディングス	9,100	1,389.000	12,639,900
建設技術研究所	4,400	4,570.000	20,108,000
スペース	7,100	927.000	6,581,700
燦ホールディングス	3,800	2,123.000	8,067,400
スバル興業	700	11,280.000	7,896,000
東京テアトル	8,400	1,135.000	9,534,000
ナガワ	2,300	6,930.000	15,939,000
東京都競馬	7,200	3,930.000	28,296,000
カナモト	14,400	2,628.000	37,843,200
ニシオホールディングス	7,600	3,570.000	27,132,000
トランス・コスモス	10,400	3,145.000	32,708,000
乃村工藝社	36,600	864.000	31,622,400
藤田観光	3,800	4,940.000	18,772,000
K N T - C Tホールディングス	5,600	1,405.000	7,868,000
トーカイ	7,500	1,907.000	14,302,500
セコム	86,200	10,190.000	878,378,000
セントラル警備保障	4,700	3,150.000	14,805,000
丹青社	17,000	866.000	14,722,000
メイテック	32,900	2,556.000	84,092,400
応用地質	7,800	2,644.000	20,623,200
船井総研ホールディングス	17,600	2,717.000	47,819,200
いであ	2,500	1,683.000	4,207,500
学究社	4,200	2,008.000	8,433,600
ベネッセホールディングス	31,700	1,867.000	59,183,900
イオンディライト	9,200	3,200.000	29,440,000
ダイセキ	17,300	4,185.000	72,400,500
ステップ	3,200	1,759.000	5,628,800
合 計	121,520,818		276,740,872,060

## (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9月12日現在 )	( 2023年9月11日現在 )
資産の部		
流動資産		
預金	3,391,761,553	1,445,957,107
金銭信託	59,808,893	7,372,615
コール・ローン	1,681,028,129	312,106,304
株式	418,939,787,808	569,929,396,265
投資証券	11,249,570,387	12,160,647,103
派生商品評価勘定	60,354,105	14,804,960
未収入金	23,211,666	33,825,475
未収配当金	864,034,421	1,014,274,287
差入委託証拠金	2,760,184,509	949,230,375
流動資産合計	439,029,741,471	585,867,614,491
資産合計	439,029,741,471	585,867,614,491
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	128,889,077	17,124,929
未払解約金	162,621,000	156,963,106
その他未払費用	3,444	8,320
流動負債合計	291,513,521	174,096,355
負債合計	291,513,521	174,096,355
純資産の部		
元本等		
元本	69,094,291,205	80,285,355,686
剰余金		
剰余金又は欠損金 ( )	369,643,936,745	505,408,162,450
元本等合計	438,738,227,950	585,693,518,136
純資産合計	438,738,227,950	585,693,518,136
負債純資産合計	439,029,741,471	585,867,614,491

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2022年9月13日 至 2023年9月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。

	<p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 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9月12日現在）	（2023年9月11日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	69,094,291,205口	80,285,355,686口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 6.3498円 （1万口当たりの純資産額63,498円）	1口当たり純資産額 7.2951円 （1万口当たりの純資産額72,951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9月13日 至 2023年9月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、投資証券を組み入れております。</p>



	<p>2) デリバティブ取引</p> <p>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
<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9月11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>

	(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9月12日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	S&P 500 EMINI FUT SEP22	6,690,495,733	-	6,651,129,185	39,366,548
	SPI 200 FUTURES SEP22	320,502,700	-	319,632,725	869,975
	FTSE 100 IDX FUT SEP22	379,115,789	-	378,834,640	281,149
	EURO STOXX 50 SEP22	1,195,871,658	-	1,176,182,770	19,688,888
	小計	8,585,985,880	-	8,525,779,320	60,206,560
	合 計	8,585,985,880	-	8,525,779,320	60,206,560

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益	
			う ち 1 年 超			
為替予約取引 買建	アメリカ・ドル	1,168,388,166	-	1,160,919,696	7,468,470	
	カナダ・ドル	56,159,908	-	55,946,420	213,488	
	オーストラリア・ドル	26,361,720	-	26,388,720	27,000	
	香港・ドル	14,277,130	-	14,186,740	90,390	
	シンガポール・ドル	7,176,161	-	7,145,785	30,376	
	イギリス・ポンド	71,379,692	-	71,314,681	65,011	
	イスラエル・シケル	3,768,601	-	3,769,828	1,227	
	スイス・フラン	44,594,262	-	44,654,042	59,780	
	デンマーク・クローネ	10,877,972	-	10,830,024	47,948	
	ノルウェー・クローネ	3,458,721	-	3,467,570	8,849	

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

(2023年9月11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 SEP23	2,816,973,990	-	2,819,696,609	2,722,619
	SPI 200 FUTURES SEP23	117,201,550	-	117,617,500	415,950
	FTSE 100 IDX FUT SEP23	149,809,019	-	151,117,659	1,308,640
	EURO STOXX 50 SEP23	534,513,892	-	527,743,826	6,770,066
	小計	3,618,498,451	-	3,616,175,594	2,322,857
	合計	3,618,498,451	-	3,616,175,594	2,322,857

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(単位：円)

	契約額等	

区 分	種 類		うち 1年超	時 価	評価損益
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	176,716,609	-	176,719,497	2,888
	小計	176,716,609	-	176,719,497	2,888
	合 計	176,716,609	-	176,719,497	2,888

## (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9月13日 至 2023年9月11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9月12日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	59,015,956,817円
同期中における追加設定元本額	20,494,529,737円
同期中における一部解約元本額	10,416,195,349円
2022年9月12日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	35,123,557,567円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	275,483,003円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,087,497,791円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	775,204,438円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	32,852,387円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	991,074円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	5,203,753円

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	16,441,879円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	48,359,688円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	52,502,521円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	102,719,093円
外国株式指数ファンド	912,210,161円
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	16,360,503,530円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	87,908,136円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	97,508,641円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	63,989,360円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	18,659,575円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	129,836,552円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	115,457,713円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	417,317,703円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	223,443,393円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	259,357,529円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	51,775,463円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	1,286,812,799円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	10,651,413円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	44,388,614円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	39,139,513円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,603,182円
SMB C・DCインデックスファンド(M S C I コクサイ)	297,954,594円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	211,751,353円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	1,158,782,933円
三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド	42,491,244円
S M A M・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	476,572,355円
バランスファンドV A(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	3,247,568円
S M A M・バランスファンドV A 安定成長型 < 適格機関投資家限定 >	21,720,183円
S M A M・バランスファンドV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	572,483,865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 >	732,038,670円
S M A M・バランスファンドV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	3,177,896,398円
S M A M・バランスファンドV L 3 0 < 適格機関投資家限定 >	10,511,330円
S M A M・バランスファンドV L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	52,946,745円
S M A M・バランスファンドV A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	427,084,701円
S M A M・バランスファンドV L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	38,301,233円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	93,355,655円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	440,464,244円
S M A M・バランスファンドV A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	302,091,664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 >	713,165,783円
S M A M・バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	200,225円
三井住友・外国株式インデックスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	198,878,953円
S M A M・グローバルバランス4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	62,426,977円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	7,719,760円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	6,951,628円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	3,930,927円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	18,307,293円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	53,269,072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 >	113,544,613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 >	50,332,592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 >	322,507,095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 >	82,837,181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 >	1,673,632,092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 >	14,551,834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 >	11,351,913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 >	14,541,240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 >	44,070,821円
合 計	69,094,291,205円

(2023年9月11日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	69,094,291,205円
同期中における追加設定元本額	20,220,370,634円
同期中における一部解約元本額	9,029,306,153円
2023年9月11日現在の元本の内訳	
三井住友・D C 外国株式インデックスファンド S	39,947,626,157円
三井住友・D C 年金バランス 3 0 (債券重点型)	288,872,736円
三井住友・D C 年金バランス 5 0 (標準型)	1,114,280,201円
三井住友・D C 年金バランス 7 0 (株式重点型)	815,724,504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)	31,975,460円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 2 0 (4資産タイプ)	866,919円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 2 5 (4資産タイプ)	4,357,225円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 3 0 (4資産タイプ)	14,119,075円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 3 5 (4資産タイプ)	43,555,666円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 4 0 (4資産タイプ)	52,652,732円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 4 5 (4資産タイプ)	109,889,814円
外国株式指数ファンド	1,005,322,004円
三井住友・D C つみたて N I S A ・ 全海外株インデックスファンド	20,961,308,631円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	118,818,176円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	151,850,228円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	91,497,818円
イオン・バランス戦略ファンド	24,596,891円
三井住友 D S ・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 5 0	24,933,853円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	140,085,726円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	128,019,945円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	490,747,585円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	293,424,933円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	394,219,966円
三井住友・D C つみたて N I S A ・ 世界分散ファンド	60,936,519円
三井住友 D S ・ 外国株式インデックス年金ファンド	2,210,041,998円
三井住友 D S ・ 年金バランス 3 0 (債券重点型)	11,129,714円
三井住友 D S ・ 年金バランス 5 0 (標準型)	55,569,565円
三井住友 D S ・ 年金バランス 7 0 (株式重点型)	53,014,111円
三井住友 D S ・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 6 0	3,205,314円

SMBC・DCインデックスファンド(MSCIコクサイ)	873,388,944円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	297,199,867円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	2,316,652,259円
三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド	94,405,191円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	19,245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	30,142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)	96,982円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	1,095,017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)	5,036,135円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	2,491,452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)	1,538,674円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	353,445,856円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	2,435,607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>	14,085,258円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	390,119,752円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	598,731,327円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	2,644,112,230円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	8,840,391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>	382,756,601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>	31,123,233円
SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	74,041,043円
SMAM・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>	375,737,406円
SMAM・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>	243,895,256円
SMAM・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>	566,929,127円
SMAM・バランスVA株40T <適格機関投資家限定>	181,246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)	177,806,517円
SMAM・グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	48,611,426円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	5,871,789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>	13,508,815円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用>	44,155,646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>	170,474,139円
SMAM・世界バランスファンドVA2 <適格機関投資家限定>	56,978,052円
SMAM・外国株式インデックスファンドSA <適格機関投資家限定>	1,469,056,578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>	24,813,997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>	14,256,202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>	22,698,063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>	128,392,752円

SMDAM・年金Wリスクコントロールファンド(リスク3%)&lt;適格機関投資家限

定&gt;

10,458,542円

合計

80,285,355,686円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	APA CORP	19,759	44.260	874,533.34	
	BAKER HUGHES CO	78,082	36.950	2,885,129.90	
	CHENIERE ENERGY INC	17,754	162.680	2,888,220.72	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	7,695	88.490	680,930.55	
	CHEVRON CORP	136,457	167.210	22,816,974.97	
	CONOCOPHILLIPS	91,705	122.720	11,254,037.60	
	COTERRA ENERGY INC	59,741	28.200	1,684,696.20	
	DEVON ENERGY CORP	49,897	52.660	2,627,576.02	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,065	156.030	2,038,531.95	
	EOG RESOURCES INC	43,830	132.730	5,817,555.90	
	EQT CORP	26,411	42.480	1,121,939.28	
	EXXON MOBIL CORP	304,036	115.610	35,149,601.96	
	HALLIBURTON CO	67,581	41.280	2,789,743.68	
	HESS CORP	21,198	160.520	3,402,702.96	
	HF SINCLAIR CORP	10,663	60.990	650,336.37	
	KINDER MORGAN INC	156,197	16.800	2,624,109.60	
	MARATHON OIL CORP	42,380	27.310	1,157,397.80	
	MARATHON PETROLEUM CORP	32,636	155.310	5,068,697.16	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	51,961	65.280	3,392,014.08	
	ONEOK INC	31,946	64.770	2,069,142.42	
	OVINTIV INC	16,672	47.320	788,919.04	
	PHILLIPS 66	33,814	122.230	4,133,085.22	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	17,516	238.820	4,183,171.12	
	SCHLUMBERGER LTD	105,197	60.170	6,329,703.49	
	TARGA RESOURCES CORP	15,416	85.330	1,315,447.28	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	417	1,849.490	771,237.33	
	VALERO ENERGY CORP	26,805	142.060	3,807,918.30	
	WILLIAMS COS INC	92,048	33.820	3,113,063.36	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	17,056	298.510	5,091,386.56	
	ALBEMARLE CORP	8,338	184.430	1,537,777.34	
	AMCOR PLC	97,610	9.250	902,892.50	
	AVERY DENNISON CORP	5,454	181.060	987,501.24	
BALL CORP	23,469	52.090	1,222,500.21		
CELANESE CORP	8,742	124.550	1,088,816.10		
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	14,020	83.740	1,174,034.80		



CLEVELAND-CLIFFS INC	33,403	14.240	475,658.72	
CORTEVA INC	53,900	49.580	2,672,362.00	
CROWN HOLDINGS INC	9,413	89.940	846,605.22	
DOW INC	53,862	53.710	2,892,928.02	
DUPONT DE NEMOURS INC	34,201	75.410	2,579,097.41	
EASTMAN CHEMICAL CO	9,517	79.530	756,887.01	
ECOLAB INC	19,574	182.060	3,563,642.44	
FMC CORP	8,548	75.460	645,032.08	
FREEMPORT-MCMORAN INC	106,789	39.290	4,195,739.81	
INTERNATIONAL PAPER CO	23,472	34.630	812,835.36	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	17,659	68.730	1,213,703.07	
LINDE PLC	36,966	386.810	14,298,818.46	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,214	99.380	1,909,487.32	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,759	438.090	2,084,870.31	
MOSAIC CO/THE	25,489	37.650	959,660.85	
NEWMONT CORP	62,601	38.730	2,424,536.73	
NUCOR CORP	18,997	164.940	3,133,365.18	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,111	146.560	1,042,188.16	
PPG INDUSTRIES INC	16,735	135.700	2,270,939.50	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	4,056	270.200	1,095,931.20	
RPM INTERNATIONAL INC	10,397	98.800	1,027,223.60	
SEALED AIR CORP	13,326	33.960	452,550.96	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	18,266	271.450	4,958,305.70	
STEEL DYNAMICS INC	12,713	102.940	1,308,676.22	
VULCAN MATERIALS CO	9,892	216.250	2,139,145.00	
WESTLAKE CORP	2,189	124.930	273,471.77	
WESTROCK CO	16,766	34.570	579,600.62	
3M CO	42,482	106.240	4,513,287.68	
AECOM	10,261	84.870	870,851.07	
AERCAP HOLDINGS NV	13,505	61.830	835,014.15	
ALLEGION PLC	6,843	108.100	739,728.30	
AMETEK INC	16,587	153.900	2,552,739.30	
AXON ENTERPRISE INC	4,672	214.710	1,003,125.12	
BOEING CO/THE	43,359	211.270	9,160,455.93	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	9,801	139.890	1,371,061.89	
CARLISLE COS INC	3,499	251.360	879,508.64	
CARRIER GLOBAL CORP	61,324	58.660	3,597,265.84	
CATERPILLAR INC	39,051	282.280	11,023,316.28	
CUMMINS INC	10,159	234.870	2,386,044.33	
DEERE & CO	20,718	399.660	8,280,155.88	
DOVER CORP	10,436	142.110	1,483,059.96	
EATON CORP PLC	29,468	236.130	6,958,278.84	
EMERSON ELECTRIC CO	41,763	98.950	4,132,448.85	
FASTENAL CO	41,551	54.510	2,264,945.01	

FERGUSON PLC	16,077	153.950	2,475,054.15	
FORTIVE CORP	25,083	77.560	1,945,437.48	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	10,648	65.590	698,402.32	
GENERAC HOLDINGS INC	3,973	115.180	457,610.14	
GENERAL DYNAMICS CORP	17,778	217.870	3,873,292.86	
GENERAL ELECTRIC CO	82,651	111.720	9,233,769.72	
GRACO INC	11,645	75.710	881,642.95	
HEICO CORP	3,085	164.410	507,204.85	
HEICO CORP-CLASS A	4,570	131.970	603,102.90	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	50,521	184.520	9,322,134.92	
HOWMET AEROSPACE INC	27,783	47.650	1,323,859.95	
HUBBELL INC	3,897	327.570	1,276,540.29	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,888	210.840	608,905.92	
IDEX CORP	6,048	216.090	1,306,912.32	
ILLINOIS TOOL WORKS	23,264	238.450	5,547,300.80	
INGERSOLL-RAND INC	29,314	69.420	2,034,977.88	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	11,600	47.650	552,740.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	52,470	57.350	3,009,154.50	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	14,388	167.940	2,416,320.72	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,104	387.240	814,752.96	
LOCKHEED MARTIN CORP	17,095	423.090	7,232,723.55	
MASCO CORP	14,885	56.230	836,983.55	
NORDSON CORP	3,927	232.800	914,205.60	
NORTHROP GRUMMAN CORP	10,937	422.720	4,623,288.64	
OTIS WORLDWIDE CORP	31,838	82.710	2,633,320.98	
OWENS CORNING	7,597	142.850	1,085,231.45	
PACCAR INC	39,980	84.510	3,378,709.80	
PARKER HANNIFIN CORP	9,607	409.200	3,931,184.40	
PENTAIR PLC	11,509	68.080	783,532.72	
QUANTA SERVICES INC	10,416	206.500	2,150,904.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,678	296.860	2,576,151.08	
RTX CORP	110,909	83.480	9,258,683.32	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	12,538	37.100	465,159.80	
SMITH (A.O.) CORP	10,652	70.190	747,663.88	
SNAP-ON INC	4,041	259.740	1,049,609.34	
STANLEY BLACK & DECKER INC	10,869	90.990	988,970.31	
TEXTRON INC	14,870	75.600	1,124,172.00	
TORO CO	8,097	82.340	666,706.98	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	17,225	205.940	3,547,316.50	
TRANSDIGM GROUP INC	4,165	871.890	3,631,421.85	
UNITED RENTALS INC	5,383	463.770	2,496,473.91	
WABTEC CORP	12,782	106.570	1,362,177.74	
WATSCO INC	2,364	349.490	826,194.36	
WW GRAINGER INC	3,504	689.930	2,417,514.72	

XYLEM INC	16,831	95.220	1,602,647.82	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	30,587	249.370	7,627,480.19	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	10,637	111.950	1,190,812.15	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	8,963	187.730	1,682,623.99	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,485	73.110	766,558.35	
CINTAS CORP	6,998	495.130	3,464,919.74	
CLARIVATE PLC	19,939	6.990	139,373.61	
COPART INC	62,164	44.690	2,778,109.16	
EQUIFAX INC	9,133	196.560	1,795,182.48	
JACOBS SOLUTIONS INC	10,393	130.740	1,358,780.82	
LEIDOS HOLDINGS INC	8,863	95.800	849,075.40	
PAYCHEX INC	24,917	120.540	3,003,495.18	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,778	284.310	1,074,123.18	
PAYLOCITY HOLDING CORP	2,718	195.310	530,852.58	
REPUBLIC SERVICES INC	16,065	146.220	2,349,024.30	
ROBERT HALF INC	8,149	73.200	596,506.80	
ROLLINS INC	16,081	36.110	580,684.91	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	14,487	55.730	807,360.51	
TRANSUNION	14,503	79.830	1,157,774.49	
VERISK ANALYTICS INC	11,354	244.380	2,774,690.52	
WASTE CONNECTIONS INC	20,167	137.840	2,779,819.28	
WASTE MANAGEMENT INC	30,236	156.450	4,730,422.20	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,726	86.320	753,228.32	
CSX CORP	154,835	29.950	4,637,308.25	
DELTA AIR LINES INC	14,192	40.820	579,317.44	
EXPEDITORS INTL WASH INC	10,436	114.730	1,197,322.28	
FEDEX CORP	18,074	253.310	4,578,324.94	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	159,485	3.720	593,284.20	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	6,308	184.630	1,164,646.04	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	12,089	52.260	631,771.14	
NORFOLK SOUTHERN CORP	17,033	195.640	3,332,336.12	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	7,677	421.250	3,233,936.25	
SOUTHWEST AIRLINES CO	14,057	29.530	415,103.21	
UBER TECHNOLOGIES INC	138,131	47.240	6,525,308.44	
U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING	5,850	52.690	308,236.50	
UNION PACIFIC CORP	45,563	211.800	9,650,243.40	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	54,032	161.040	8,701,313.28	
APTIV PLC	21,117	100.480	2,121,836.16	
BORGWARNER INC	17,433	40.030	697,842.99	
FORD MOTOR CO	299,200	12.300	3,680,160.00	
GENERAL MOTORS CO	104,301	32.950	3,436,717.95	
LEAR CORP	3,736	141.050	526,962.80	
LUCID GROUP INC	82,293	5.840	480,591.12	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	45,698	23.100	1,055,623.80	

TESLA INC	214,241	248.500	53,238,888.50	
DECKERS OUTDOOR CORP	1,872	527.240	986,993.28	
DR HORTON INC	24,030	117.310	2,818,959.30	
GARMIN LTD	10,774	102.770	1,107,243.98	
HASBRO INC	11,407	69.940	797,805.58	
LENNAR CORP-A	19,331	118.670	2,294,009.77	
LULULEMON ATHLETICA INC	8,357	396.360	3,312,380.52	
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	94.090	269,379.67	
NIKE INC -CL B	93,516	97.670	9,133,707.72	
NVR INC	250	6,307.190	1,576,797.50	
PULTEGROUP INC	17,535	80.720	1,415,425.20	
VF CORP	20,583	18.800	386,960.40	
WHIRLPOOL CORP	4,975	136.500	679,087.50	
AIRBNB INC-CLASS A	31,310	145.820	4,565,624.20	
ARAMARK	19,232	36.580	703,506.56	
BOOKING HOLDINGS INC	2,788	3,143.100	8,762,962.80	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	15,881	54.950	872,660.95	
CARNIVAL CORP	69,745	15.300	1,067,098.50	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,100	1,945.100	4,084,710.00	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,323	149.440	1,393,229.12	
DOMINO'S PIZZA INC	2,875	387.370	1,113,688.75	
DOORDASH INC - A	20,142	82.170	1,655,068.14	
DRAFTKINGS INC-CL A	32,265	31.850	1,027,640.25	
EXPEDIA GROUP INC	10,081	109.800	1,106,893.80	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	19,380	154.120	2,986,845.60	
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,371	111.880	377,147.48	
LAS VEGAS SANDS CORP	27,977	48.870	1,367,235.99	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	19,665	205.450	4,040,174.25	
MCDONALD'S CORP	54,294	279.220	15,159,970.68	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,198	43.740	970,940.52	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,097	97.350	1,567,042.95	
STARBUCKS CORP	87,125	95.280	8,301,270.00	
VAIL RESORTS INC	2,860	249.970	714,914.20	
WYNN RESORTS LTD	7,730	94.710	732,108.30	
YUM! BRANDS INC	20,179	126.530	2,553,248.87	
AMAZON.COM INC	692,035	138.230	95,659,998.05	
AUTOZONE INC	1,315	2,619.290	3,444,366.35	
BATH & BODY WORKS INC	15,400	36.500	562,100.00	
BEST BUY CO INC	14,954	73.230	1,095,081.42	
BURLINGTON STORES INC	4,802	156.100	749,592.20	
CARMAX INC	10,366	81.180	841,511.88	
CHEWY INC - CLASS A	13,119	22.990	301,605.81	
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,406	111.400	490,828.40	
EBAY INC	40,534	43.430	1,760,391.62	

ETSY INC	9,090	67.130	610,211.70	
GENUINE PARTS CO	10,245	149.990	1,536,647.55	
GLOBAL-E ONLINE LTD	8,896	40.070	356,462.72	
HOME DEPOT INC	75,103	328.710	24,687,107.13	
LKQ CORP	18,982	50.460	957,831.72	
LOWE'S COS INC	43,814	231.290	10,133,740.06	
MERCADOLIBRE INC	3,384	1,428.190	4,832,994.96	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,512	958.360	4,324,120.32	
POOL CORP	3,252	344.260	1,119,533.52	
ROSS STORES INC	24,702	119.360	2,948,430.72	
TJX COMPANIES INC	85,065	91.450	7,779,194.25	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,071	217.390	1,754,554.69	
ULTA BEAUTY INC	3,734	413.710	1,544,793.14	
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	20,378	23.630	481,532.14	
COSTCO WHOLESALE CORP	33,432	551.190	18,427,384.08	
DOLLAR GENERAL CORP	15,800	127.200	2,009,760.00	
DOLLAR TREE INC	15,923	116.020	1,847,386.46	
KROGER CO	49,890	46.940	2,341,836.60	
SYSCO CORP	36,352	69.950	2,542,822.40	
TARGET CORP	34,331	123.690	4,246,401.39	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	52,808	21.990	1,161,247.92	
WALMART INC	111,744	163.770	18,300,314.88	
ALTRIA GROUP INC	134,504	44.080	5,928,936.32	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	42,289	78.810	3,332,796.09	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	22,643	64.310	1,456,171.33	
BUNGE LTD	12,343	112.380	1,387,106.34	
CAMPBELL SOUP CO	12,945	42.180	546,020.10	
COCA-COLA CO/THE	309,873	58.330	18,074,892.09	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,803	61.330	969,197.99	
CONAGRA BRANDS INC	39,722	29.100	1,155,910.20	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,701	259.200	3,292,099.20	
DARLING INGREDIENTS INC	10,514	58.550	615,594.70	
GENERAL MILLS INC	42,268	66.150	2,796,028.20	
HERSHEY CO/THE	11,180	209.030	2,336,955.40	
HORMEL FOODS CORP	25,536	37.120	947,896.32	
JM SMUCKER CO/THE	8,172	141.580	1,156,991.76	
KELLOGG CO	19,503	59.420	1,158,868.26	
KEURIG DR PEPPER INC	68,147	33.360	2,273,383.92	
KRAFT HEINZ CO/THE	62,228	32.960	2,051,034.88	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	10,534	98.400	1,036,545.60	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,425	80.700	1,486,897.50	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	12,477	63.640	794,036.28	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	100,607	69.820	7,024,380.74	
MONSTER BEVERAGE CORP	60,052	56.370	3,385,131.24	

PEPSICO INC	103,827	176.270	18,301,585.29	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	117,573	93.670	11,013,062.91	
TYSON FOODS INC-CL A	19,731	52.050	1,026,998.55	
CHURCH & DWIGHT CO INC	17,113	95.670	1,637,200.71	
CLOROX COMPANY	9,104	154.700	1,408,388.80	
COLGATE-PALMOLIVE CO	58,956	73.200	4,315,579.20	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	17,009	154.000	2,619,386.00	
KENVUE INC	112,611	21.300	2,398,614.30	
KIMBERLY-CLARK CORP	25,378	127.480	3,235,187.44	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	177,416	152.930	27,132,228.88	
ABBOTT LABORATORIES	131,477	100.730	13,243,678.21	
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,703	332.260	1,894,878.78	
BAXTER INTERNATIONAL INC	39,241	38.670	1,517,449.47	
BECTON DICKINSON AND CO	21,072	266.760	5,621,166.72	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	106,596	53.870	5,742,326.52	
CARDINAL HEALTH INC	18,000	88.780	1,598,040.00	
CENCORA INC	12,209	177.700	2,169,539.30	
CENTENE CORP	40,300	65.410	2,636,023.00	
COOPER COS INC/THE	3,384	350.010	1,184,433.84	
CVS HEALTH CORP	96,086	65.840	6,326,302.24	
DAVITA INC	4,138	95.550	395,385.90	
DENTSPLY SIRONA INC	17,715	36.000	637,740.00	
DEXCOM INC	30,245	104.350	3,156,065.75	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	44,049	74.070	3,262,709.43	
ELEVANCE HEALTH INC	17,496	448.750	7,851,330.00	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	31,160	64.900	2,022,284.00	
HCA HEALTHCARE INC	15,058	273.580	4,119,567.64	
HENRY SCHEIN INC	10,457	73.880	772,563.16	
HOLOGIC INC	19,730	72.230	1,425,097.90	
HUMANA INC	9,498	467.730	4,442,499.54	
IDEXX LABORATORIES INC	6,043	465.790	2,814,768.97	
INSULET CORP	5,082	171.920	873,697.44	
INTUITIVE SURGICAL INC	26,647	298.220	7,946,668.34	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	6,245	203.310	1,269,670.95	
MCKESSON CORP	10,067	420.780	4,235,992.26	
MEDTRONIC PLC	101,168	79.960	8,089,393.28	
MOLINA HEALTHCARE INC	4,673	320.470	1,497,556.31	
QUEST DIAGNOSTICS INC	7,645	127.020	971,067.90	
RESMED INC	10,758	147.950	1,591,646.10	
STERIS PLC	7,525	222.750	1,676,193.75	
STRYKER CORP	25,167	289.540	7,286,853.18	
TELEFLEX INC	3,067	206.800	634,255.60	
THE CIGNA GROUP	22,335	281.480	6,286,855.80	
UNITEDHEALTH GROUP INC	70,017	480.770	33,662,073.09	

UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,203	131.500	552,694.50	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	10,315	220.310	2,272,497.65	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,537	120.650	1,874,539.05	
ABBVIE INC	133,033	149.020	19,824,577.66	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	23,121	113.990	2,635,562.79	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,171	201.430	1,847,314.53	
AMGEN INC	40,506	259.430	10,508,471.58	
AVANTOR INC	56,039	20.230	1,133,668.97	
BIOGEN INC	11,114	258.990	2,878,414.86	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	13,832	90.190	1,247,508.08	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,728	357.910	618,468.48	
BIO-TECHNE CORP	13,296	71.820	954,918.72	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	159,354	60.820	9,691,910.28	
CATALENT INC	16,025	48.480	776,892.00	
CHARLES RIVER LABORATORIES	3,467	199.740	692,498.58	
DANAHER CORP	52,921	248.360	13,143,459.56	
ELI LILLY & CO	60,686	586.460	35,589,911.56	
EXACT SCIENCES CORP	13,570	78.330	1,062,938.10	
GILEAD SCIENCES INC	92,189	76.000	7,006,364.00	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	16,100	115.420	1,858,262.00	
ILLUMINA INC	11,573	158.360	1,832,700.28	
INCYTE CORP	15,899	63.980	1,017,218.02	
IQVIA HOLDINGS INC	14,439	213.530	3,083,159.67	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,089	136.400	557,739.60	
JOHNSON & JOHNSON	180,442	160.560	28,971,767.52	
MERCK & CO. INC.	191,252	109.050	20,856,030.60	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,691	1,130.700	1,912,013.70	
MODERNA INC	23,790	107.640	2,560,755.60	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,359	109.270	694,847.93	
PFIZER INC	419,949	34.250	14,383,253.25	
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,098	830.690	6,726,927.62	
REPLIGEN CORP	3,456	161.420	557,867.52	
REVVITY INC	10,411	106.830	1,112,207.13	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	27,162	29.190	792,858.78	
SEAGEN INC	10,328	204.430	2,111,353.04	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	82,214	9.620	790,898.68	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	28,688	518.270	14,868,129.76	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,537	225.130	796,284.81	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,346	343.050	6,636,645.30	
VIATRIS INC	83,466	10.110	843,841.26	
WATERS CORP	4,095	263.570	1,079,319.15	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,276	393.160	2,074,312.16	
ZOETIS INC	34,274	185.780	6,367,423.72	
BANK OF AMERICA CORP	541,247	28.360	15,349,764.92	

CITIGROUP INC	143,867	40.590	5,839,561.53	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	36,122	27.370	988,659.14	
FIFTH THIRD BANCORP	49,541	26.410	1,308,377.81	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	845	1,326.540	1,120,926.30	
FIRST HORIZON CORP	39,014	11.830	461,535.62	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	105,007	10.870	1,141,426.09	
JPMORGAN CHASE & CO	219,809	143.830	31,615,128.47	
KEYCORP	62,741	11.250	705,836.25	
M & T BANK CORP	12,629	121.780	1,537,959.62	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	30,337	116.930	3,547,305.41	
REGIONS FINANCIAL CORP	62,979	17.920	1,128,583.68	
TRUIST FINANCIAL CORP	101,687	29.780	3,028,238.86	
US BANCORP	116,120	36.110	4,193,093.20	
WEBSTER FINANCIAL CORP	13,918	41.500	577,597.00	
WELLS FARGO & CO	275,847	41.000	11,309,727.00	
ALLY FINANCIAL INC	20,139	27.980	563,489.22	
AMERICAN EXPRESS CO	47,398	157.430	7,461,867.14	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,978	345.050	2,752,808.90	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	31,181	87.860	2,739,562.66	
ARES MANAGEMENT CORP - A	11,370	105.960	1,204,765.20	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	61,100	44.780	2,736,058.00	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	97,122	363.150	35,269,854.30	
BLACKROCK INC	11,045	690.620	7,627,897.90	
BLACKSTONE INC	53,294	112.670	6,004,634.98	
BLOCK INC	38,443	53.080	2,040,554.44	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	29,775	99.920	2,975,118.00	
CARLYLE GROUP INC/THE	16,730	32.350	541,215.50	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	7,323	153.060	1,120,858.38	
CME GROUP INC	26,755	204.990	5,484,507.45	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	13,634	82.090	1,119,215.06	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	18,645	89.570	1,670,032.65	
EQUITABLE HOLDINGS INC	22,820	28.480	649,913.60	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,946	429.000	1,263,834.00	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	42,749	55.330	2,365,302.17	
FISERV INC	46,955	121.600	5,709,728.00	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	5,089	271.840	1,383,393.76	
FRANKLIN RESOURCES INC	21,778	25.930	564,703.54	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	6,533	57.950	378,587.35	
GLOBAL PAYMENTS INC	20,594	125.910	2,592,990.54	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	24,977	325.520	8,130,513.04	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	41,649	114.960	4,787,969.04	
INVESCO LTD	18,328	15.450	283,167.60	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,971	151.400	752,609.40	
KKR & CO INC	47,224	62.820	2,966,611.68	



LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	6,164	242.500	1,494,770.00	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,653	226.630	601,249.39	
MASTERCARD INC - A	63,063	414.840	26,161,054.92	
MOODY'S CORP	12,518	339.770	4,253,240.86	
MORGAN STANLEY	92,428	84.920	7,848,985.76	
MSCI INC	6,223	533.790	3,321,775.17	
NASDAQ INC	27,999	51.430	1,439,988.57	
NORTHERN TRUST CORP	16,793	76.390	1,282,817.27	
PAYPAL HOLDINGS INC	80,330	60.980	4,898,523.40	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	14,529	106.330	1,544,868.57	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	31,965	10.740	343,304.10	
S&P GLOBAL INC	24,887	390.710	9,723,599.77	
SCHWAB (CHARLES) CORP	111,107	59.330	6,591,978.31	
SEI INVESTMENTS COMPANY	7,550	61.370	463,343.50	
STATE STREET CORP	25,474	70.160	1,787,255.84	
SYNCHRONY FINANCIAL	32,112	31.280	1,004,463.36	
T ROWE PRICE GROUP INC	17,303	109.240	1,890,179.72	
TOAST INC-CLASS A	21,393	20.840	445,830.12	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	8,688	86.220	749,079.36	
VISA INC-CLASS A SHARES	121,762	247.290	30,110,524.98	
AFLAC INC	44,628	74.830	3,339,513.24	
ALLSTATE CORP	20,503	106.200	2,177,418.60	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,866	110.010	535,308.66	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	55,264	59.660	3,297,050.24	
AON PLC-CLASS A	14,865	333.450	4,956,734.25	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,061	77.255	2,245,107.55	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,577	228.190	3,782,705.63	
ASSURANT INC	3,114	138.360	430,853.04	
BROWN & BROWN INC	18,424	73.120	1,347,162.88	
CHUBB LTD	31,161	204.670	6,377,721.87	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,510	105.000	1,103,550.00	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,244	276.420	620,286.48	
EVEREST GROUP LTD	3,547	370.700	1,314,872.90	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	19,058	42.800	815,682.40	
GLOBE LIFE INC	6,373	109.160	695,676.68	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	21,767	71.490	1,556,122.83	
LOEWS CORP	12,727	62.430	794,546.61	
MARKEL GROUP INC	957	1,473.080	1,409,737.56	
MARSH & MCLENNAN COS	36,569	194.760	7,122,178.44	
METLIFE INC	47,592	63.310	3,013,049.52	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	19,458	75.380	1,466,744.04	
PROGRESSIVE CORP	43,469	135.760	5,901,351.44	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	27,229	95.090	2,589,205.61	
TRAVELERS COS INC/THE	16,719	159.890	2,673,200.91	

WILLIS TOWERS WATSON PLC	7,897	202.820	1,601,669.54	
WR BERKLEY CORP	14,486	61.930	897,117.98	
ACCENTURE PLC-CL A	47,644	325.470	15,506,692.68	
ADOBE INC	34,076	560.360	19,094,827.36	
AKAMA I TECHNOLOGIES INC	10,300	104.680	1,078,204.00	
ANSYS INC	6,763	314.350	2,125,949.05	
ASPEN TECHNOLOGY INC	1,901	195.080	370,847.08	
ATLASSIAN CORP-CL A	10,941	206.600	2,260,410.60	
AUTODESK INC	16,146	219.190	3,539,041.74	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	18,166	49.020	890,497.32	
BILL HOLDINGS INC	6,004	116.020	696,584.08	
BLACK KNIGHT INC	10,656	75.760	807,298.56	
CADENCE DESIGN SYS INC	20,318	237.990	4,835,480.82	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	7,561	135.660	1,025,725.26	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	19,210	62.680	1,204,082.80	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	36,763	71.340	2,622,672.42	
CONFLUENT INC-CLASS A	15,954	32.300	515,314.20	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	16,959	168.090	2,850,638.31	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,173	168.350	534,174.55	
DATADOG INC - CLASS A	18,911	97.660	1,846,848.26	
DOCUSIGN INC	17,164	50.210	861,804.44	
DROPBOX INC-CLASS A	16,584	27.880	462,361.92	
DYNATRACE INC	15,753	47.360	746,062.08	
EPAM SYSTEMS INC	4,815	265.350	1,277,660.25	
FAIR ISAAC CORP	1,871	899.720	1,683,376.12	
FORTINET INC	47,604	64.070	3,049,988.28	
GARTNER INC	6,179	354.150	2,188,292.85	
GEN DIGITAL INC	41,779	19.990	835,162.21	
GODADDY INC - CLASS A	11,895	74.580	887,129.10	
HUBSPOT INC	3,318	537.190	1,782,396.42	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	68,871	147.680	10,170,869.28	
INTUIT INC	21,212	550.560	11,678,478.72	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	4,648	200.480	931,831.04	
MICROSOFT CORP	529,731	334.270	177,073,181.37	
MONDAY.COM LTD	1,879	171.200	321,684.80	
MONGODB INC	5,236	377.290	1,975,490.44	
OKTA INC	10,337	87.380	903,247.06	
ORACLE CORP	122,999	126.320	15,537,233.68	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	128,742	15.130	1,947,866.46	
PALO ALTO NETWORKS INC	22,821	248.740	5,676,495.54	
PTC INC	9,246	143.640	1,328,095.44	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,088	491.510	3,975,332.88	
SALESFORCE INC	73,560	224.760	16,533,345.60	
SERVICENOW INC	15,473	600.070	9,284,883.11	

SNOWFLAKE INC-CLASS A	20,323	165.950	3,372,601.85	
SPLUNK INC	12,234	124.280	1,520,441.52	
SYNOPSYS INC	11,669	459.140	5,357,704.66	
TWILIO INC - A	10,905	65.480	714,059.40	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,139	392.170	1,231,021.63	
UIPATH INC - CLASS A	25,298	18.480	467,507.04	
UNITY SOFTWARE INC	19,066	37.680	718,406.88	
VERISIGN INC	6,425	206.560	1,327,148.00	
VMWARE INC-CLASS A	17,852	165.990	2,963,253.48	
WIX.COM LTD	4,119	93.070	383,355.33	
WORKDAY INC-CLASS A	15,569	250.630	3,902,058.47	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	18,307	72.060	1,319,202.42	
ZSCALER INC	6,271	160.770	1,008,188.67	
AMPHENOL CORP-CL A	45,311	85.890	3,891,761.79	
APPLE INC	1,178,730	178.180	210,026,111.40	
ARISTA NETWORKS INC	20,286	196.470	3,985,590.42	
ARROW ELECTRONICS INC	4,130	126.360	521,866.80	
CDW CORP/DE	9,855	212.670	2,095,862.85	
CISCO SYSTEMS INC	304,623	56.670	17,262,985.41	
COGNEX CORP	11,368	43.570	495,303.76	
CORNING INC	58,470	31.370	1,834,203.90	
DELL TECHNOLOGIES -C	18,797	70.500	1,325,188.50	
F5 INC	3,921	160.550	629,516.55	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	102,647	17.340	1,779,898.98	
HP INC	66,419	29.450	1,956,039.55	
JABIL INC	9,808	107.330	1,052,692.64	
JUNIPER NETWORKS INC	21,151	29.070	614,859.57	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	13,320	132.300	1,762,236.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,784	282.500	3,611,480.00	
NETAPP INC	17,045	79.090	1,348,089.05	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	13,715	65.370	896,549.55	
SUPER MICRO COMPUTER INC	3,540	280.660	993,536.40	
TE CONNECTIVITY LTD	23,194	127.860	2,965,584.84	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,432	410.220	1,407,875.04	
TRIMBLE INC	20,783	50.980	1,059,517.34	
WESTERN DIGITAL CORP	24,533	43.470	1,066,449.51	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,189	256.370	1,073,933.93	
ADVANCED MICRO DEVICES	121,818	106.090	12,923,671.62	
ANALOG DEVICES INC	37,327	177.470	6,624,422.69	
APPLIED MATERIALS INC	62,167	147.530	9,171,497.51	
BROADCOM INC	30,906	857.550	26,503,440.30	
ENPHASE ENERGY INC	10,381	120.230	1,248,107.63	
ENTEGRIS INC	9,961	96.130	957,550.93	
FIRST SOLAR INC	6,859	183.210	1,256,637.39	

INTEL CORP	316,085	38.010	12,014,390.85	
KLA CORP	10,049	497.730	5,001,688.77	
LAM RESEARCH CORP	10,243	668.880	6,851,337.84	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	11,073	91.660	1,014,951.18	
MARVELL TECHNOLOGY INC	65,112	55.740	3,629,342.88	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	40,124	78.780	3,160,968.72	
MICRON TECHNOLOGY INC	81,266	70.180	5,703,247.88	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,399	500.870	1,702,457.13	
NVIDIA CORP	185,105	455.720	84,356,050.60	
NXP SEMICONDUCTORS NV	19,715	203.050	4,003,130.75	
ON SEMICONDUCTOR	31,206	97.920	3,055,691.52	
QORVO INC	7,835	99.340	778,328.90	
QUALCOMM INC	83,212	106.140	8,832,121.68	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	10,677	99.380	1,061,080.26	
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	4,104	148.850	610,880.40	
TERADYNE INC	10,642	99.700	1,061,007.40	
TEXAS INSTRUMENTS INC	68,725	164.660	11,316,258.50	
WOLFSPEED INC	8,461	41.990	355,277.39	
AT&T INC	534,592	14.400	7,698,124.80	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	21,079	18.980	400,079.42	
T-MOBILE US INC	41,344	137.630	5,690,174.72	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	318,519	33.450	10,654,460.55	
AES CORP	54,086	17.270	934,065.22	
ALLIANT ENERGY CORP	21,204	50.740	1,075,890.96	
AMEREN CORPORATION	19,979	79.410	1,586,532.39	
AMERICAN ELECTRIC POWER	37,302	77.740	2,899,857.48	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,191	137.730	2,092,256.43	
ATMOS ENERGY CORP	10,802	114.180	1,233,372.36	
CENTERPOINT ENERGY INC	44,329	28.290	1,254,067.41	
CMS ENERGY CORP	20,578	55.970	1,151,750.66	
CONSOLIDATED EDISON INC	25,230	89.250	2,251,777.50	
CONSTELLATION ENERGY	25,008	108.640	2,716,869.12	
DOMINION ENERGY INC	60,534	47.120	2,852,362.08	
DTE ENERGY COMPANY	16,277	102.660	1,670,996.82	
DUKE ENERGY CORP	57,237	91.020	5,209,711.74	
EDISON INTERNATIONAL	27,815	69.800	1,941,487.00	
ENTERGY CORP	14,800	95.270	1,409,996.00	
ESSENTIAL UTILITIES INC	16,329	36.620	597,967.98	
EVERGY INC	17,275	53.940	931,813.50	
EVERSOURCE ENERGY	25,375	62.080	1,575,280.00	
EXELON CORP	76,292	40.580	3,095,929.36	
FIRSTENERGY CORP	37,970	35.620	1,352,491.40	
NEXTERA ENERGY INC	151,970	66.830	10,156,155.10	
NISOURCE INC	34,855	26.970	940,039.35	

NRG ENERGY INC	20,349	39.510	803,988.99	
P G & E CORP	149,297	16.960	2,532,077.12	
PPL CORP	55,523	24.750	1,374,194.25	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	37,236	60.790	2,263,576.44	
SEMPRA	48,838	71.250	3,479,707.50	
SOUTHERN CO/THE	80,927	67.930	5,497,371.11	
VISTRA CORP	25,777	34.060	877,964.62	
WEC ENERGY GROUP INC	22,571	84.670	1,911,086.57	
XCEL ENERGY INC	40,756	57.070	2,325,944.92	
ACTIVISION BLIZZARD INC	58,916	92.120	5,427,341.92	
ALPHABET INC-CL A	445,227	136.380	60,720,058.26	
ALPHABET INC-CL C	396,590	137.200	54,412,148.00	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,601	422.420	3,210,814.42	
COMCAST CORP-CLASS A	313,150	45.030	14,101,144.50	
ELECTRONIC ARTS INC	19,428	121.750	2,365,359.00	
FOX CORP - CLASS A	23,886	31.360	749,064.96	
FOX CORP - CLASS B	8,773	28.900	253,539.70	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	26,027	31.750	826,357.25	
LIBERTY BROADBAND-C	8,196	89.880	736,656.48	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW	12,383	23.150	286,666.45	
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	13,438	66.000	886,908.00	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	11,080	80.940	896,815.20	
MATCH GROUP INC	17,799	44.050	784,045.95	
META PLATFORMS INC-CLASS A	165,862	297.890	49,408,631.18	
NETFLIX INC	33,145	442.800	14,676,606.00	
NEWS CORP - CLASS A	23,102	21.060	486,528.12	
OMNICOM GROUP	15,106	78.900	1,191,863.40	
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	40,964	13.660	559,568.24	
PINTEREST INC- CLASS A	48,115	27.550	1,325,568.25	
ROBLOX CORP -CLASS A	29,846	29.010	865,832.46	
ROKU INC	9,945	83.470	830,109.15	
SEA LTD-ADR	28,149	38.250	1,076,699.25	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	56,550	4.260	240,903.00	
SNAP INC - A	70,689	9.390	663,769.71	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,652	142.770	1,806,326.04	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	32,608	83.890	2,735,485.12	
WALT DISNEY CO/THE	138,365	81.580	11,287,816.70	
WARNER BROS DISCOVERY INC	165,916	11.320	1,878,169.12	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	24,629	17.590	433,224.11	
CBRE GROUP INC - A	23,502	85.240	2,003,310.48	
COSTAR GROUP INC	30,836	82.570	2,546,128.52	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	79,100	3.640	287,924.00	
ZILLOW GROUP INC - C	10,672	50.910	543,311.52	
アメリカ・ドル小計	25,576,985		2,897,619,924.04	

				(425,863,200,236)	
カナダ・ド ル	ARC RESOURCES LTD	44,923	21.070	946,527.61	
	CAMECO CORP	33,586	50.550	1,697,772.30	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	82,506	88.590	7,309,206.54	
	CENOVUS ENERGY INC	99,824	27.890	2,784,091.36	
	ENBRIDGE INC	155,165	45.770	7,101,902.05	
	IMPERIAL OIL LTD	16,267	79.010	1,285,255.67	
	KEYERA CORP	19,802	32.880	651,089.76	
	PARKLAND CORP	7,666	39.660	304,033.56	
	PEMBINA PIPELINE CORP	37,348	41.790	1,560,772.92	
	SUNCOR ENERGY INC	100,785	46.840	4,720,769.40	
	TC ENERGY CORP	73,652	49.050	3,612,630.60	
	TOURMALINE OIL CORP	26,107	70.000	1,827,490.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	36,483	64.620	2,357,531.46	
	BARRICK GOLD CORP	125,529	21.550	2,705,149.95	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,268	58.680	778,566.24	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	41,452	33.830	1,402,321.16	
	FRANCO-NEVADA CORP	14,724	189.960	2,796,971.04	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	56,432	11.670	658,561.44	
	KINROSS GOLD CORP	110,156	6.520	718,217.12	
	LUNDIN MINING CORP	46,446	10.360	481,180.56	
	NUTRIEN LTD	36,792	85.740	3,154,546.08	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	25,157	21.070	530,057.99	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	34,947	54.940	1,919,988.18	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,438	95.840	425,337.92	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	34,221	57.560	1,969,760.76	
	CAE INC	27,474	32.560	894,553.44	
	STANTEC INC	9,939	89.490	889,441.11	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	6,027	110.540	666,224.58	
	WSP GLOBAL INC	9,260	190.280	1,761,992.80	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	15,630	44.080	688,970.40	
	RB GLOBAL INC	12,520	90.380	1,131,557.60	
	THOMSON REUTERS CORP	12,639	175.410	2,217,006.99	
	AIR CANADA	12,083	21.300	257,367.90	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	42,942	147.150	6,318,915.30	
	CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	68,555	104.220	7,144,802.10	
	TFI INTERNATIONAL INC	5,097	179.650	915,676.05	
MAGNA INTERNATIONAL INC	22,436	78.180	1,754,046.48		
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,082	101.470	312,730.54		
GILDAN ACTIVEWEAR INC	11,302	38.480	434,900.96		
RESTAURANT BRANDS INTERN	21,066	92.350	1,945,445.10		
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	4,737	152.320	721,539.84		
DOLLARAMA INC	20,468	87.560	1,792,178.08		
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	57,969	71.500	4,144,783.50		

EMPIRE CO LTD 'A'	9,148	34.770	318,075.96	
LOBLAW COMPANIES LTD	11,573	118.130	1,367,118.49	
METRO INC/CN	18,929	70.730	1,338,848.17	
WESTON (GEORGE) LTD	4,984	152.150	758,315.60	
SAPUTO INC	18,270	29.060	530,926.20	
BANK OF MONTREAL	53,693	114.190	6,131,203.67	
BANK OF NOVA SCOTIA	88,900	63.470	5,642,483.00	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	64,792	53.190	3,446,286.48	
NATIONAL BANK OF CANADA	25,956	92.510	2,401,189.56	
ROYAL BANK OF CANADA	105,193	120.100	12,633,679.30	
TORONTO-DOMINION BANK	139,736	80.630	11,266,913.68	
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	23,555	47.720	1,124,044.60	
BROOKFIELD CORP	103,140	46.610	4,807,355.40	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	32,674	20.380	665,896.12	
IGM FINANCIAL INC	4,949	37.470	185,439.03	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	5,042	24.540	123,730.68	
ONEX CORPORATION	4,217	83.770	353,258.09	
TMX GROUP LTD	26,034	29.680	772,689.12	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,745	1,114.170	1,944,226.65	
GREAT-WEST LIFECO INC	22,964	39.640	910,292.96	
IA FINANCIAL CORP INC	8,268	84.270	696,744.36	
INTACT FINANCIAL CORP	12,446	193.250	2,405,189.50	
MANULIFE FINANCIAL CORP	134,995	25.150	3,395,124.25	
POWER CORP OF CANADA	41,436	37.040	1,534,789.44	
SUN LIFE FINANCIAL INC	41,957	65.550	2,750,281.35	
CGI INC	15,720	139.250	2,189,010.00	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,480	2,761.970	4,087,715.60	
CONSTELLATION SOFTWARE-RTS	1,480	0.275	407.00	
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,424	101.870	654,412.88	
OPEN TEXT CORP	21,507	53.230	1,144,817.61	
SHOPIFY INC - CLASS A	88,905	85.990	7,644,940.95	
BCE INC	5,509	55.280	304,537.52	
QUEBECOR INC -CL B	14,578	29.500	430,051.00	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	28,451	53.250	1,515,015.75	
TELUS CORP	15,222	22.840	347,670.48	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	44,154	9.700	428,293.80	
ALTAGAS LTD	27,309	26.800	731,881.20	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,200	36.120	404,544.00	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	7,344	31.610	232,143.84	
EMERA INC	22,591	50.060	1,130,905.46	
FORTIS INC	35,086	53.370	1,872,539.82	
HYDRO ONE LTD	24,747	35.570	880,250.79	
NORTHLAND POWER INC	15,741	24.180	380,617.38	
FIRSTSERVICE CORP	3,669	205.200	752,878.80	

カナダ・ドル小計		3,036,615		180,328,599.98 (19,446,636,222)	
オーストラ リア・ドル	AMPOL LTD	19,016	34.420	654,530.72	
	SANTOS LTD	239,685	7.780	1,864,749.30	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	141,315	37.990	5,368,556.85	
	BHP GROUP LTD	376,828	43.190	16,275,201.32	
	BLUESCOPE STEEL LTD	37,214	21.320	793,402.48	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	121,817	19.400	2,363,249.80	
	IGO LTD	54,323	14.310	777,362.13	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	33,723	46.170	1,556,990.91	
	MINERAL RESOURCES LTD	11,662	69.080	805,610.96	
	NEWCREST MINING LTD	64,961	25.720	1,670,796.92	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	92,960	11.040	1,026,278.40	
	ORICA LTD	36,212	15.600	564,907.20	
	PILBARA MINERALS LTD	197,160	4.510	889,191.60	
	RIO TINTO LTD	29,368	111.170	3,264,840.56	
	SOUTH32 LTD	336,639	3.280	1,104,175.92	
	REECE LTD	13,059	19.240	251,255.16	
	BRAMBLES LTD	105,161	15.120	1,590,034.32	
	COMPUTERSHARE LTD	38,485	25.780	992,143.30	
	AURIZON HOLDINGS LTD	130,251	3.600	468,903.60	
	QANTAS AIRWAYS LTD	78,226	5.540	433,372.04	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	45,243	40.620	1,837,770.66	
	IDP EDUCATION LTD	15,855	24.460	387,813.30	
	LOTTERY CORP LTD/THE	173,268	4.830	836,884.44	
	WESFARMERS LTD	83,000	53.200	4,415,600.00	
	COLES GROUP LTD	99,972	15.750	1,574,559.00	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	138,738	5.260	729,761.88	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	88,246	37.750	3,331,286.50	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	45,684	11.430	522,168.12	
	COCHLEAR LTD	5,404	269.290	1,455,243.16	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	14,565	49.150	715,869.75	
	SONIC HEALTHCARE LTD	31,126	31.100	968,018.60	
	CSL LTD	35,557	270.850	9,630,613.45	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	224,517	24.930	5,597,208.81	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	124,266	100.810	12,527,255.46	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	237,426	28.650	6,802,254.90		
WESTPAC BANKING CORP	254,756	21.170	5,393,184.52		
ASX LTD	15,385	55.140	848,328.90		
MACQUARIE GROUP LTD	28,015	171.110	4,793,646.65		
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	22,786	33.420	761,508.12		
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	173,755	5.790	1,006,041.45		
MEDIBANK PRIVATE LTD	193,702	3.510	679,894.02		
QBE INSURANCE GROUP LTD	124,450	15.120	1,881,684.00		



	SUNCORP GROUP LTD	88,234	13.770	1,214,982.18	
	WISETECH GLOBAL LTD	10,621	68.650	729,131.65	
	XERO LTD	11,173	122.550	1,369,251.15	
	TELSTRA GROUP LTD	273,343	3.930	1,074,237.99	
	ORIGIN ENERGY LTD	134,865	8.520	1,149,049.80	
	REA GROUP LTD	3,813	163.090	621,862.17	
	SEEK LTD	29,833	22.530	672,137.49	
	オーストラリア・ドル小計	4,885,663		116,242,801.61 (10,926,823,351)	
香港・ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	196,924	41.350	8,142,807.40	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	101,000	75.800	7,655,800.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	94,000	11.480	1,079,120.00	
	MTR CORP	118,500	32.050	3,797,925.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	160,000	13.940	2,230,400.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	176,000	49.700	8,747,200.00	
	SANDS CHINA LTD	172,800	25.900	4,475,520.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	147,000	16.740	2,460,780.00	
	WH GROUP LTD	561,000	4.070	2,283,270.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	247,000	22.350	5,520,450.00	
	HANG SENG BANK LTD	63,400	97.050	6,152,970.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	88,000	307.200	27,033,600.00	
	AIA GROUP LTD	868,200	68.000	59,037,600.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	41,000	38.350	1,572,350.00	
	CLP HOLDINGS LTD	119,600	59.200	7,080,320.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	861,389	5.690	4,901,303.41	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	91,500	38.450	3,518,175.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	160,924	41.550	6,686,392.20	
	ESR GROUP LTD	157,000	11.920	1,871,440.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	190,000	10.520	1,998,800.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	83,384	21.150	1,763,571.60	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	84,833	16.840	1,428,587.72	
	SINO LAND CO	248,200	9.020	2,238,764.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	108,000	88.300	9,536,400.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	27,000	57.900	1,563,300.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	116,800	16.500	1,927,200.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	125,000	32.100	4,012,500.00	
	香港・ドル小計	5,408,454		188,716,546.33 (3,536,548,078)	
シンガポール・ドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	10,800	32.130	347,004.00	
	KEPPEL CORP LTD	94,400	6.810	642,864.00	
	SEATRUM LTD	3,231,727	0.140	452,441.78	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	108,600	3.850	418,110.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	113,566	6.740	765,434.84	
	GENTING SINGAPORE LTD	452,500	0.880	398,200.00	

	WILMAR INTERNATIONAL LTD	159,600	3.650	582,540.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	130,900	33.230	4,349,807.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	258,400	12.430	3,211,912.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	93,500	28.280	2,644,180.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	65,200	9.630	627,876.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	579,015	2.320	1,343,314.80	
	SEBNCORP INDUSTRIES LTD	89,200	5.120	456,704.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	220,100	3.130	688,913.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	49,000	6.690	327,810.00	
	UOL GROUP LTD	30,900	6.430	198,687.00	
	シンガポール・ドル小計	5,687,408		17,455,798.42 (1,881,211,396)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	90,913	7.910	719,121.83	
	EBOS GROUP LTD	12,972	36.290	470,753.88	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	45,732	21.450	980,951.40	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	132,027	4.920	649,572.84	
	MERCURY NZ LTD	48,206	6.220	299,841.32	
	MERIDIAN ENERGY LTD	91,327	5.170	472,160.59	
	ニュージーランド・ドル小計	421,177		3,592,401.86 (311,820,481)	
イギリス・ポンド	BP PLC	1,284,625	5.173	6,645,365.12	
	SHELL PLC	508,042	25.025	12,713,751.05	
	ANGLO AMERICAN PLC	95,436	20.230	1,930,670.28	
	ANTOFAGASTA PLC	30,983	14.665	454,365.69	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,296	52.400	539,510.40	
	ENDEAVOUR MINING PLC	17,507	15.540	272,058.78	
	GLENCORE PLC	773,648	4.260	3,295,740.48	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,637	17.500	343,647.50	
	MONDI PLC	33,905	12.915	437,883.07	
	RIO TINTO PLC	83,083	48.345	4,016,647.63	
	ASHTREAD GROUP PLC	30,439	51.900	1,579,784.10	
	BAE SYSTEMS PLC	231,522	10.275	2,378,888.55	
	BUNZL PLC	22,658	28.070	636,010.06	
	DCC PLC	5,954	43.840	261,023.36	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	119,456	5.108	610,181.24	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	649,146	2.204	1,430,717.78	
	SMITHS GROUP PLC	24,369	16.585	404,159.86	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,904	99.840	589,455.36	
	EXPERIAN PLC	69,750	27.780	1,937,655.00	
	INTERTEK GROUP PLC	11,884	42.050	499,722.20	
RELX PLC	144,062	27.220	3,921,367.64		
RENTOKIL INITIAL PLC	190,467	5.890	1,121,850.63		
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,766	4.363	282,574.05		
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,637	39.720	263,621.64		

BURBERRY GROUP PLC	26,233	21.260	557,713.58	
PERSIMMON PLC	27,665	10.180	281,629.70	
TAYLOR WIMPEY PLC	225,588	1.131	255,140.02	
COMPASS GROUP PLC	127,518	20.490	2,612,843.82	
ENTAIN PLC	42,158	11.730	494,513.34	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	11,820	61.340	725,038.80	
PEARSON PLC	46,942	8.818	413,934.55	
WHITBREAD PLC	16,522	36.000	594,792.00	
JD SPORTS FASHION PLC	251,482	1.377	346,290.71	
KINGFISHER PLC	179,593	2.261	406,059.77	
NEXT PLC	9,030	71.080	641,852.40	
OCADO GROUP PLC	42,697	8.268	353,018.79	
SAINSBURY (J) PLC	113,480	2.669	302,878.12	
TESCO PLC	551,571	2.586	1,426,362.60	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	24,258	19.840	481,278.72	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	157,793	25.920	4,089,994.56	
COCA-COLA HBC AG-DI	17,866	22.570	403,235.62	
DIAGEO PLC	169,199	32.000	5,414,368.00	
IMPERIAL BRANDS PLC	59,422	17.560	1,043,450.32	
HALEON PLC	415,231	3.188	1,323,756.42	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	53,559	58.060	3,109,635.54	
UNILEVER PLC	190,822	40.425	7,713,979.35	
NMC HEALTH PLC	3,940	0.010	39.40	
SMITH & NEPHEW PLC	57,278	10.670	611,156.26	
ASTRAZENECA PLC	115,098	108.460	12,483,529.08	
GSK PLC	311,133	14.442	4,493,382.78	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	14,590	20.860	304,347.40	
BARCLAYS PLC	1,208,742	1.482	1,791,355.64	
HSBC HOLDINGS PLC	1,465,067	5.844	8,561,851.54	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,801,858	0.413	1,983,167.35	
NATWEST GROUP PLC	407,238	2.241	912,620.35	
STANDARD CHARTERED PLC	182,397	7.056	1,286,993.23	
3I GROUP PLC	70,572	19.935	1,406,852.82	
ABRDN PLC	138,015	1.565	215,993.47	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	31,008	7.394	229,273.15	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	30,487	82.640	2,519,445.68	
M&G PLC	119,733	1.936	231,803.08	
SCHRODERS PLC	61,711	4.033	248,880.46	
ST JAMES'S PLACE PLC	33,823	8.492	287,224.91	
WISE PLC - A	43,661	6.526	284,931.68	
ADMIRAL GROUP PLC	19,808	23.580	467,072.64	
AVIVA PLC	217,835	3.692	804,246.82	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	457,083	2.166	990,041.77	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	59,286	5.122	303,662.89	

	PRUDENTIAL PLC	211,966	8.966	1,900,487.15	
	SAGE GROUP PLC/THE	75,045	10.200	765,459.00	
	HALMA PLC	32,277	21.770	702,670.29	
	BT GROUP PLC	540,623	1.121	606,038.38	
	VODAFONE GROUP PLC	1,629,376	0.732	1,192,703.23	
	CENTRICA PLC	403,810	1.619	653,768.39	
	NATIONAL GRID PLC	280,606	9.964	2,795,958.18	
	SEVERN TRENT PLC	20,117	24.230	487,434.91	
	SSE PLC	78,838	16.265	1,282,300.07	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	51,208	9.522	487,602.57	
	AUTO TRADER GROUP PLC	77,901	6.022	469,119.82	
	INFORMA PLC	102,755	7.410	761,414.55	
	WPP PLC	78,503	7.606	597,093.81	
	イギリス・bond小計	20,628,013		132,678,340.95 (24,351,782,698)	
イスラエル・シュケル	ICL GROUP LTD	67,143	22.450	1,507,360.35	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,389	764.500	1,061,890.50	
	BANK HAPOALIM BM	98,327	31.000	3,048,137.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	115,937	28.880	3,348,260.56	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	85,339	18.740	1,599,252.86	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	11,916	123.100	1,466,859.60	
	NICE LTD	3,919	725.000	2,841,275.00	
	AZRIELI GROUP LTD	3,527	201.900	712,101.30	
	イスラエル・シュケル小計	387,497		15,585,137.17 (594,516,878)	
スイス・フラン	CLARIANT AG-REG	10,101	14.500	146,464.50	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	538	653.000	351,314.00	
	GIVAUDAN-REG	680	2,900.000	1,972,000.00	
	HOLCIM LTD	39,459	56.740	2,238,903.66	
	SIG GROUP AG	22,269	22.560	502,388.64	
	SIKA AG-REG	11,005	242.600	2,669,813.00	
	ABB LTD-REG	119,421	32.870	3,925,368.27	
	GEBERIT AG-REG	2,322	447.200	1,038,398.40	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,766	180.900	319,469.40	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,030	190.600	577,518.00	
	VAT GROUP AG	2,164	342.600	741,386.40	
	ADECCO GROUP AG-REG	14,810	36.720	543,823.20	
	SGS SA-REG	11,450	81.960	938,442.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	4,194	260.100	1,090,859.40	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	39,172	117.000	4,583,124.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,716	248.700	426,769.20	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	5,225	47.400	247,665.00	
	DUFREY AG-REG	8,656	37.390	323,647.84	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	216	1,505.000	325,080.00		

	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	72	10,570.000	761,040.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	103,800.000	830,400.00	
	NESTLE SA-REG	200,093	105.220	21,053,785.46	
	ALCON INC	35,956	73.600	2,646,361.60	
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,173	215.200	898,029.60	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,823	128.500	1,133,755.50	
	BACHEM HOLDING AG	1,756	74.250	130,383.00	
	LONZA GROUP AG-REG	5,801	483.800	2,806,523.80	
	NOVARTIS AG-REG	154,681	88.120	13,630,489.72	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,584	279.200	721,452.80	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	52,244	256.700	13,411,034.80	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	3,006	95.200	286,171.20	
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,168	58.680	890,058.24	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,585	1,021.500	1,619,077.50	
	UBS GROUP AG-REG	248,248	22.760	5,650,124.48	
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,909	142.900	558,596.10	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,221	137.000	304,277.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,272	558.200	1,268,230.40	
	SWISS RE AG	22,781	88.920	2,025,686.52	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,172	411.000	4,591,692.00	
	TEMENOS AG - REG	3,743	66.280	248,086.04	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	13,555	62.900	852,609.50	
	SWISSCOM AG-REG	1,994	541.800	1,080,349.20	
	BKW AG	1,385	164.700	228,109.50	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,572	84.900	473,062.80	
	スイス・フラン小計	1,100,996		101,061,821.67 (16,652,966,975)	
デンマーク・クローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	7,211	470.200	3,390,612.20	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	15,785	309.600	4,887,036.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	513	1,718.500	881,590.50	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	78,424	146.260	11,470,294.24	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	206	12,090.000	2,490,540.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	412	12,300.000	5,067,600.00	
	DSV A/S	13,716	1,297.500	17,796,510.00	
	PANDORA A/S	5,888	724.000	4,262,912.00	
	CARLSBERG AS-B	8,080	971.600	7,850,528.00	
	COLOPLAST-B	8,316	776.600	6,458,205.60	
	DEMANT A/S	8,178	290.400	2,374,891.20	
	GENMAB A/S	4,634	2,635.000	12,210,590.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	122,785	1,355.200	166,398,232.00	
	DANSKE BANK A/S	50,000	153.650	7,682,500.00	
	TRYG A/S	24,975	132.850	3,317,928.75	
ORSTED A/S	14,988	386.300	5,789,864.40		
	デンマーク・クローネ小計	364,111		262,329,834.89	

				(5,540,406,113)	
ノル ウェー・ク ローネ	AKER BP ASA	21,204	298.400	6,327,273.60	
	EQUINOR ASA	72,237	346.500	25,030,120.50	
	NORSK HYDRO ASA	108,109	58.780	6,354,647.02	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,718	409.500	5,208,021.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	6,526	484.000	3,158,584.00	
	MOWI ASA	30,723	191.400	5,880,382.20	
	ORKLA ASA	63,195	80.560	5,090,989.20	
	SALMAR ASA	4,188	526.200	2,203,725.60	
	DNB BANK ASA	66,810	209.600	14,003,376.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,691	161.200	3,012,989.20	
	TELENOR ASA	48,435	111.700	5,410,189.50	
	ADEVINTA ASA	15,540	73.400	1,140,636.00	
ノルウェー・クローネ小計		468,376		82,820,933.82 (1,140,444,259)	
スウェーデ ン・クロ ーナ	BOLIDEN AB	20,658	291.600	6,023,872.80	
	HOLMEN AB-B SHARES	7,024	406.500	2,855,256.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	52,203	143.350	7,483,300.05	
	ALFA LAVAL AB	23,093	384.900	8,888,495.70	
	ASSA ABLOY AB-B	72,539	243.900	17,692,262.10	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	200,121	146.750	29,367,756.75	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	125,066	128.600	16,083,487.60	
	BEIJER REF AB	23,918	126.300	3,020,843.40	
	EPIROC AB-A	44,746	213.900	9,571,169.40	
	EPIROC AB-B	33,182	183.300	6,082,260.60	
	HUSQVARNA AB-B SHS	34,897	85.600	2,987,183.20	
	INDUTRADE AB	17,913	211.500	3,788,599.50	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,223	199.650	1,641,721.95	
	LIFCO AB-B SHS	15,149	202.100	3,061,612.90	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	109,274	80.760	8,824,968.24	
	SAAB AB-B	6,953	593.000	4,123,129.00	
	SANDVIK AB	76,866	204.500	15,719,097.00	
	SKANSKA AB-B SHS	26,915	164.600	4,430,209.00	
	SKF AB-B SHARES	31,715	177.350	5,624,655.25	
	VOLVO AB-A SHS	13,283	221.400	2,940,856.20	
	VOLVO AB-B SHS	111,479	219.900	24,514,232.10	
	SECURITAS AB-B SHS	41,010	85.560	3,508,815.60	
	VOLVO CAR AB-B	38,628	38.500	1,487,178.00	
	EVOLUTION AB	13,101	1,205.000	15,786,705.00	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	52,210	166.740	8,705,495.40		
ESSITY AKTIEBOLAG-B	45,427	245.000	11,129,615.00		
GETINGE AB-B SHS	13,151	185.850	2,444,113.35		
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	13,513	217.000	2,932,321.00		
NORDEA BANK ABP	248,187	119.900	29,757,621.30		

	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	129,315	126.650	16,377,744.75	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	113,533	92.740	10,529,050.42	
	SWEDBANK AB - A SHARES	63,538	191.500	12,167,527.00	
	EQT AB	23,194	215.300	4,993,668.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	7,211	287.700	2,074,604.70	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,642	287.700	3,061,703.40	
	INVESTOR AB-B SHS	131,535	212.200	27,911,727.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	6,081	456.100	2,773,544.10	
	ERICSSON LM-B SHS	221,040	56.800	12,555,072.00	
	HEXAGON AB-B SHS	157,105	95.400	14,987,817.00	
	TELE2 AB-B SHS	38,424	77.440	2,975,554.56	
	TELIA CO AB	187,675	22.100	4,147,617.50	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	31,938	51.240	1,636,503.12	
	SAGAX AB-B	14,721	227.100	3,343,139.10	
	スウェーデン・クローナ小計	2,656,396		380,012,106.24 (5,031,360,287)	
ユーロ	ENI SPA	167,120	14.798	2,473,041.76	
	GALP ENERGIA SGPS SA	31,670	13.670	432,928.90	
	NESTE OYJ	31,509	33.600	1,058,702.40	
	OMV AG	10,043	45.310	455,048.33	
	REPSOL SA	96,457	14.900	1,437,209.30	
	TENARIS SA	41,201	14.965	616,572.96	
	TOTALENERGIES SE	169,457	60.380	10,231,813.66	
	AIR LIQUIDE SA	39,911	165.480	6,604,472.28	
	AKZO NOBEL N.V.	12,475	73.120	912,172.00	
	ARCELORMITTAL	33,606	24.205	813,433.23	
	ARKEMA	5,145	93.320	480,131.40	
	BASF SE	64,323	44.480	2,861,087.04	
	COVESTRO AG	16,049	51.500	826,523.50	
	CRH PLC	55,174	50.760	2,800,632.24	
	DSM-FIRMENICH AG	13,915	81.030	1,127,532.45	
	EVONIK INDUSTRIES AG	17,669	17.810	314,684.89	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	10,008	72.000	720,576.00	
	OCI NV	6,000	25.340	152,040.00	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	20,828	34.880	726,480.64	
	SOLVAY SA	4,802	106.750	512,613.50	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	39,228	11.400	447,199.20	
	SYMRISE AG	9,721	92.360	897,831.56	
	UMICORE	16,912	23.260	393,373.12	
	UPM-KYMMENE OYJ	38,447	30.780	1,183,398.66	
	VOESTALPINE AG	10,410	26.860	279,612.60	
	WACKER CHEMIE AG	1,414	133.650	188,981.10	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	14,086	32.480	457,513.28	
	AIRBUS SE	43,824	135.440	5,935,522.56	

ALSTOM	25,574	23.710	606,359.54	
BOUYGUES SA	17,123	31.760	543,826.48	
BRENTAG SE	12,153	74.080	900,294.24	
CNH INDUSTRIAL NV	82,028	12.610	1,034,373.08	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	34,454	57.370	1,976,625.98	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	35,066	32.490	1,139,294.34	
DASSAULT AVIATION SA	1,720	181.600	312,352.00	
EIFFAGE	6,641	90.900	603,666.90	
FERROVIAL SE	38,869	29.650	1,152,465.85	
GEA GROUP AG	10,467	36.600	383,092.20	
IMCD NV	4,340	123.650	536,641.00	
KINGSPAN GROUP PLC	11,262	73.640	829,333.68	
KNORR-BREMSE AG	7,217	59.160	426,957.72	
KONE OYJ-B	24,225	41.010	993,467.25	
LEGRAND SA	19,539	90.760	1,773,359.64	
METSO CORP	50,483	10.430	526,537.69	
MTU AERO ENGINES AG	3,854	207.900	801,246.60	
PRYSMIAN SPA	19,681	37.900	745,909.90	
RATIONAL AG	350	659.500	230,825.00	
RHEINMETALL AG	2,899	244.600	709,095.40	
SAFRAN SA	25,961	148.540	3,856,246.94	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	41,472	157.120	6,516,080.64	
SIEMENS AG-REG	56,806	137.120	7,789,238.72	
SIEMENS ENERGY AG	40,928	12.220	500,140.16	
THALES SA	7,074	138.700	981,163.80	
VINCI SA	38,750	102.960	3,989,700.00	
WARTSILA OYJ ABP	38,260	11.365	434,824.90	
BUREAU VERITAS SA	17,817	24.510	436,694.67	
RANDSTAD NV	8,946	52.060	465,728.76	
TELEPERFORMANCE	4,299	126.800	545,113.20	
WOLTERS KLUWER	18,802	114.150	2,146,248.30	
ADP	1,346	116.400	156,674.40	
AENA SME SA	5,640	146.100	824,004.00	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	50,885	8.070	410,641.95	
DHL GROUP	73,067	41.205	3,010,725.73	
GETLINK SE	30,428	15.335	466,613.38	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	23,310	95.620	2,228,902.20	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	3,679	87.750	322,832.25	
CONTINENTAL AG	8,078	66.060	533,632.68	
DR ING HC F PORSCHE AG	8,498	101.300	860,847.40	
FERRARI NV	8,992	279.300	2,511,465.60	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	61,762	65.830	4,065,792.46	
MICHELIN (CGDE)	51,844	29.520	1,530,434.88	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	10,089	48.080	485,079.12	



RENAULT SA	14,764	35.985	531,282.54	
STELLANTIS NV	171,748	17.000	2,919,716.00	
VALEO	14,444	17.405	251,397.82	
VOLKSWAGEN AG	1,960	121.250	237,650.00	
VOLKSWAGEN AG-PREF	15,275	107.060	1,635,341.50	
ADIDAS AG	12,090	175.980	2,127,598.20	
HERMES INTERNATIONAL	2,402	1,849.400	4,442,258.80	
KERING	5,801	469.700	2,724,729.70	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	20,510	740.000	15,177,400.00	
MONCLER SPA	15,710	58.500	919,035.00	
PUMA SE	9,601	61.240	587,965.24	
SEB SA	1,127	90.150	101,599.05	
ACCOR SA	16,469	33.740	555,664.06	
AMADEUS IT GROUP SA	32,915	62.420	2,054,554.30	
DELIVERY HERO SE	13,293	30.395	404,040.73	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	13,239	166.200	2,200,321.80	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,785	32.420	187,549.70	
SODEXO SA	6,960	100.850	701,916.00	
D' IETEREN GROUP	1,885	157.500	296,887.50	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	81,748	35.290	2,884,886.92	
PROSUS NV	52,559	63.080	3,315,421.72	
ZALANDO SE	17,418	25.080	436,843.44	
CARREFOUR SA	49,914	16.985	847,789.29	
HELLOFRESH SE	9,790	29.260	286,455.40	
JERONIMO MARTINS	22,106	21.920	484,563.52	
KESKO OYJ-B SHS	20,250	18.035	365,208.75	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	71,069	28.920	2,055,315.48	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	66,143	52.420	3,467,216.06	
DANONE	50,315	53.570	2,695,374.55	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	35,407	11.860	419,927.02	
HEINEKEN HOLDING NV	7,962	72.150	574,458.30	
HEINEKEN NV	22,805	87.000	1,984,035.00	
JDE PEET'S NV	13,317	25.180	335,322.06	
KERRY GROUP PLC-A	12,402	84.020	1,042,016.04	
LOTUS BAKERIES	31	7,260.000	225,060.00	
PERNOD RICARD SA	14,736	174.500	2,571,432.00	
REMY COINTREAU	2,008	136.350	273,790.80	
BEIERSDORF AG	6,813	121.800	829,823.40	
HENKEL AG & CO KGAA	8,714	64.000	557,696.00	
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	13,009	71.320	927,801.88	
L'OREAL	17,738	404.250	7,170,586.50	
AMPLIFON SPA	10,123	29.050	294,073.15	
BIOMERIEUX	2,791	92.080	256,995.28	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,583	84.140	301,473.62	

DIASORIN SPA	1,313	91.860	120,612.18	
ESSILORLUXOTTICA	21,958	173.340	3,806,199.72	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	17,125	40.000	685,000.00	
FRESENIUS SE & CO KGAA	31,227	28.210	880,913.67	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	68,092	19.520	1,329,155.84	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	19,203	44.670	857,798.01	
ARGENX SE	4,159	484.700	2,015,867.30	
BAYER AG-REG	75,808	50.190	3,804,803.52	
EUROFINS SCIENTIFIC	9,270	54.180	502,248.60	
GRIFOLS SA	15,169	12.140	184,151.66	
IPSEN	3,380	119.300	403,234.00	
MERCK KGAA	8,996	164.650	1,481,191.40	
ORION OYJ-CLASS B	10,542	37.780	398,276.76	
QIAGEN N.V.	15,665	38.750	607,018.75	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	8,068	45.590	367,820.12	
SANOFI	86,255	100.340	8,654,826.70	
SARTORIUS AG-VORZUG	2,164	349.000	755,236.00	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,207	264.500	583,751.50	
UCB SA	10,230	82.520	844,179.60	
ABN AMRO BANK NV-CVA	28,787	13.355	384,450.38	
AIB GROUP PLC	90,921	3.954	359,501.63	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	452,595	6.970	3,154,587.15	
BANCO SANTANDER SA	1,229,919	3.408	4,191,563.95	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	75,242	8.804	662,430.56	
BNP PARIBAS	80,474	58.430	4,702,095.82	
CAIXABANK SA	308,048	3.555	1,095,110.64	
COMMERZBANK AG	73,561	9.296	683,823.05	
CREDIT AGRICOLE SA	90,899	11.158	1,014,251.04	
ERSTE GROUP BANK AG	25,105	32.080	805,368.40	
FINECOBANK SPA	43,093	11.700	504,188.10	
ING GROEP NV	270,646	12.730	3,445,323.58	
INTESA SANPAOLO	1,163,000	2.413	2,806,319.00	
KBC GROUP NV	17,643	57.980	1,022,941.14	
MEDIOBANCA SPA	47,708	12.065	575,597.02	
SOCIETE GENERALE SA	55,196	25.280	1,395,354.88	
UNICREDIT SPA	141,513	20.745	2,935,687.18	
ADYEN NV	1,553	738.900	1,147,511.70	
AMUNDI SA	3,955	53.150	210,208.25	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	146,020	9.652	1,409,385.04	
DEUTSCHE BOERSE AG	14,432	163.100	2,353,859.20	
EDENRED	20,297	58.440	1,186,156.68	
EURAZEO SE	1,792	55.650	99,724.80	
EURONEXT NV	5,502	66.250	364,507.50	
EXOR NV	8,669	81.680	708,083.92	

GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	7,933	74.720	592,753.76	
NEXI SPA	57,060	6.298	359,363.88	
SOFINA	804	204.600	164,498.40	
WENDEL	2,547	82.050	208,981.35	
WORLDLINE SA	16,677	28.140	469,290.78	
AEGON NV	127,748	4.577	584,702.59	
AGEAS	11,247	37.970	427,048.59	
ALLIANZ SE-REG	29,598	222.250	6,578,155.50	
ASR NEDERLAND NV	14,593	39.040	569,710.72	
ASSICURAZIONI GENERALI	72,382	19.090	1,381,772.38	
AXA SA	132,535	27.705	3,671,882.17	
HANNOVER RUECK SE	4,298	202.200	869,055.60	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	10,609	363.000	3,851,067.00	
NN GROUP NV	16,917	35.720	604,275.24	
POSTE ITALIANE SPA	34,720	10.110	351,019.20	
SAMPO OYJ-A SHS	36,423	40.710	1,482,780.33	
TALANX AG	5,345	64.700	345,821.50	
BECHTLE AG	4,305	45.850	197,384.25	
CAPGEMINI SE	12,750	170.300	2,171,325.00	
DASSAULT SYSTEMES SE	50,781	36.450	1,850,967.45	
NEMETSCHEK SE	5,941	61.620	366,084.42	
SAP SE	78,890	131.480	10,372,457.20	
NOKIA OYJ	404,925	3.759	1,522,113.07	
ASM INTERNATIONAL NV	3,170	432.550	1,371,183.50	
ASML HOLDING NV	30,212	586.700	17,725,380.40	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	6,286	104.550	657,201.30	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	97,120	32.200	3,127,264.00	
STMICROELECTRONICS NV	48,663	41.380	2,013,674.94	
CELLNEX TELECOM SA	41,167	34.550	1,422,319.85	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	245,684	20.140	4,948,075.76	
ELISA OYJ	10,160	44.810	455,269.60	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	28,190	11.605	327,144.95	
KONINKLIJKE KPN NV	222,179	3.231	717,860.34	
ORANGE	132,722	10.794	1,432,601.26	
TELECOM ITALIA SPA	696,355	0.310	215,870.05	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	79,654	1.708	136,049.03	
TELEFONICA SA	412,202	3.846	1,585,328.89	
ACCIONA SA	1,810	128.450	232,494.50	
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	6,849	26.540	181,772.46	
E.ON SE	164,322	11.440	1,879,843.68	
EDP RENOVAVEIS SA	27,294	16.850	459,903.90	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	227,046	4.185	950,187.51	
ELIA GROUP SA/NV	2,111	105.100	221,866.10	
ENAGAS SA	14,471	15.920	230,378.32	

ENDESA SA	25,535	19.180	489,761.30	
ENEL SPA	617,940	6.191	3,825,666.54	
ENGIE	142,233	14.828	2,109,030.92	
FORTUM OYJ	30,500	12.275	374,387.50	
IBERDROLA SA	449,851	10.910	4,907,874.41	
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,603	26.560	281,615.68	
REDEIA CORP SA	34,539	15.145	523,093.15	
RWE AG	48,289	37.100	1,791,521.90	
SNAM SPA	133,867	4.802	642,829.33	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA	101,686	7.772	790,303.59	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	48,732	28.750	1,401,045.00	
VERBUND AG	5,338	75.250	401,684.50	
BOLLORE SE	69,288	5.240	363,069.12	
PUBLICIS GROUPE	15,558	73.380	1,141,646.04	
SCOUT24 SE	4,671	63.360	295,954.56	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	66,170	23.520	1,556,318.40	
VIVENDI SE	57,161	8.194	468,377.23	
LEG IMMOBILIEN SE	6,505	67.480	438,957.40	
VONOVIA SE	52,313	22.080	1,155,071.04	
ユーロ小計	13,419,686		347,038,857.58 (54,651,679,292)	
合計	84,041,377		569,929,396,265 (569,929,396,265)	

(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	606銘柄	72.7%	74.7%
カナダ・ドル	株式	87銘柄	3.3%	3.4%
オーストラリア・ドル	株式	49銘柄	1.9%	1.9%
香港・ドル	株式	27銘柄	0.6%	0.6%
シンガポール・ドル	株式	16銘柄	0.3%	0.3%
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	81銘柄	4.2%	4.3%
イスラエル・シケル	株式	8銘柄	0.1%	0.1%
スイス・フラン	株式	44銘柄	2.8%	2.9%
デンマーク・クローネ	株式	16銘柄	0.9%	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	43銘柄	0.9%	0.9%
ユーロ	株式	223銘柄	9.3%	9.6%

(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	13,343.00	1,534,578.43	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	26,290.00	946,440.00	

	AMERICAN TOWER CORP	34,996.00	6,330,426.44	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	35,166.00	699,451.74	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,245.00	1,836,723.60	
	BOSTON PROPERTIES INC	9,604.00	639,434.32	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	7,861.00	809,604.39	
	CROWN CASTLE INC	33,131.00	3,287,920.44	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	22,476.00	2,921,430.48	
	EQUINIX INC	6,935.00	5,349,936.40	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,256.00	928,920.96	
	EQUITY RESIDENTIAL	26,128.00	1,636,919.20	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,379.00	986,544.91	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	15,328.00	1,937,305.92	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	17,613.00	863,741.52	
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	22,843.00	381,934.96	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	36,377.00	728,267.54	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	59,277.00	951,395.85	
	INVITATION HOMES INC	44,730.00	1,515,452.40	
	IRON MOUNTAIN INC	23,774.00	1,490,154.32	
	KIMCO REALTY CORP	44,824.00	832,829.92	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,567.00	1,319,289.30	
	PROLOGIS INC	69,206.00	8,476,350.88	
	PUBLIC STORAGE	11,880.00	3,251,080.80	
	REALTY INCOME CORP	49,884.00	2,759,582.88	
	REGENCY CENTERS CORP	13,101.00	839,381.07	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,176.00	1,773,537.92	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	24,260.00	2,780,681.20	
	SUN COMMUNITIES INC	10,118.00	1,202,321.94	
	UDR INC	20,610.00	796,782.60	
	VENTAS INC	28,342.00	1,201,133.96	
	VICI PROPERTIES INC	76,652.00	2,390,775.88	
	WELLTOWER INC	37,522.00	3,099,317.20	
	WEYERHAEUSER CO	54,126.00	1,737,444.60	
	WP CAREY INC	16,778.00	1,070,771.96	
	アメリカ・ドル小計	939,798.00	69,307,865.93 (10,186,177,056)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,170.00	400,656.80	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,441.00	142,346.33	
	カナダ・ドル小計	15,611.00	543,003.13 (58,557,458)	
オーストラリア・ドル	APA GROUP	89,811.00	772,374.60	
	DEXUS/AU	79,604.00	601,010.20	
	GOODMAN GROUP	133,948.00	3,106,254.12	
	GPT GROUP	121,221.00	503,067.15	
	LENLEASE GROUP	63,652.00	485,028.24	

	MIRVAC GROUP	326,863.00	768,128.05	
	SCENTRE GROUP	350,311.00	931,827.26	
	STOCKLAND	193,824.00	779,172.48	
	TRANSURBAN GROUP	235,928.00	3,109,531.04	
	VICINITY CENTRES	241,241.00	439,058.62	
	オーストラリア・ドル小計	1,836,403.00	11,495,451.76 (1,080,572,464)	
香港・ドル	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	276,000.00	2,285,280.00	
	LINK REIT	189,400.00	7,301,370.00	
	香港・ドル小計	465,400.00	9,586,650.00 (179,653,821)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	267,000.00	742,260.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	408,716.00	772,473.24	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	208,100.00	347,527.00	
	MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	112,400.00	166,352.00	
	シンガポール・ドル小計	996,216.00	2,028,612.24 (218,623,541)	
イギリス・ ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	59,857.00	345,614.31	
	SEGRO PLC	89,254.00	648,341.05	
	イギリス・ポンド小計	149,111.00	993,955.36 (182,430,567)	
ユーロ	COVIVIO	2,388.00	106,027.20	
	GECINA SA	3,082.00	301,419.60	
	KLEPIERRE	18,172.00	441,943.04	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	8,942.00	431,004.40	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	13,418.00	336,523.44	
	ユーロ小計	46,002.00	1,616,917.68 (254,632,196)	
投資証券合計			12,160,647,103 (12,160,647,103)	
合 計			12,160,647,103 (12,160,647,103)	

(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 35銘柄	1.7%	83.8%
カナダ・ドル	投資証券 2銘柄	0.0%	0.5%
オーストラリア・ドル	投資証券 10銘柄	0.2%	8.9%
香港・ドル	投資証券 2銘柄	0.0%	1.5%
シンガポール・ドル	投資証券 4銘柄	0.0%	1.8%
イギリス・ポンド	投資証券 2銘柄	0.0%	1.5%
ユーロ	投資証券 5銘柄	0.0%	2.1%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「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9月12日現在 )	( 2023年9月11日現在 )
資産の部		
流動資産		
預金	1,576,229,216	1,630,617,357
金銭信託	2,158,311	1,458,905
コール・ローン	60,662,910	61,760,109
株式	19,267,678,516	29,711,323,555
投資信託受益証券	1,211,446,537	1,628,023,643
投資証券	1,910,817,739	2,748,434,286
派生商品評価勘定	1,804,422	1,294,161
未収入金	-	4,122,136
未収配当金	47,894,311	53,082,698
差入委託証拠金	394,092,069	600,754,318
流動資産合計	24,472,784,031	36,440,871,168
資産合計	24,472,784,031	36,440,871,168
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	42,882,179	69,272,629
未払金	-	3,795,093
未払解約金	4,239,510	10,692,240
その他未払費用	597	1,369
流動負債合計	47,122,286	83,761,331
負債合計	47,122,286	83,761,331
純資産の部		
元本等		
元本	14,201,860,735	20,017,222,114
剰余金		
剰余金又は欠損金 ( )	10,223,801,010	16,339,887,723
元本等合計	24,425,661,745	36,357,109,837
純資産合計	24,425,661,745	36,357,109,837
負債純資産合計	24,472,784,031	36,440,871,168

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2022年9月13日 至 2023年9月11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>

（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9月12日現在）	（2023年9月11日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	14,201,860,735口	20,017,222,114口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.7199円 （1万口当たりの純資産額17,199円）	1口当たり純資産額 1.8163円 （1万口当たりの純資産額18,163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9月13日 至 2023年9月11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、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、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
<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9月11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9月12日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

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

(単位：円)

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

(2023年9月11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 SEP23	2,346,365,762	-	2,278,387,728	67,978,034
	小計	2,346,365,762	-	2,278,387,728	67,978,034
合計		2,346,365,762	-	2,278,387,728	67,978,034

(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				
	台湾・ドル	210,121	-	209,597	524
	小計	210,121	-	209,597	524
	売建				
	アメリカ・ドル	210,121	-	210,031	90
	小計	210,121	-	210,031	90
	合 計	420,242	-	419,628	434

(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9月13日 至 2023年9月11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9月12日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	8,888,051,553円
同期中における追加設定元本額	7,116,611,786円
同期中における一部解約元本額	1,802,802,604円

## 2022年9月12日現在の元本の内訳

三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	7,759,749,632円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	2,877,312,344円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	49,002,422円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	236,594,721円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	155,000,946円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	34,122,519円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	94,365,741円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	70,242,472円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	299,371,907円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	243,657,870円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	400,901,356円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	94,046,132円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	4,741,880円
日興FWS・新興国株インデックス（為替ヘッジあり）	494,788,425円
日興FWS・新興国株インデックス（為替ヘッジなし）	1,312,279,169円
三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド	11,175,759円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	64,507,440円
合計	14,201,860,735円

(2023年9月11日現在)

## 開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	14,201,860,735円
同期中における追加設定元本額	7,973,773,018円
同期中における一部解約元本額	2,158,411,639円

## 2023年9月11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	10,417,727,573円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	3,240,313,140円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	292,097,730円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	381,534,217円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	236,465,753円
イオン・バランス戦略ファンド	131,835,857円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	49,301,302円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	111,426,991円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	84,624,996円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	392,384,076円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	255,091,546円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	364,281,059円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	120,116,820円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	6,317,238円
日興FWS・新興国株インデックス（為替ヘッジあり）	790,947,272円
日興FWS・新興国株インデックス（為替ヘッジなし）	2,957,874,461円
三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド	68,386,705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DS・DCターゲットイヤーファンド2055	73,424円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	73,424円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	285,383円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	3,195,219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)	14,231,028円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	7,138,672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)	4,433,017円
SMAAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	86,918,516円
合計	20,017,222,114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	36,700	1.340	49,178.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	7,495	8.340	62,508.30	
	SOUTHERN COPPER CORP	2,956	78.720	232,696.32	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	14,897	24.480	364,678.56	
	NIO INC - ADR	48,147	10.040	483,395.88	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	7,199	38.550	277,521.45	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	14,239	7.190	102,378.41	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	14,499	51.800	751,048.20	
	MINISO GROUP HOLDING LTD-ADR	2,998	26.690	80,016.62	
	PDD HOLDINGS INC	20,779	95.340	1,981,069.86	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	12,137	14.920	181,084.04	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	2,074	67.640	140,285.36	
	CREDICORP LTD	2,325	134.520	312,759.00	
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	18,837	1.170	22,039.29	
	QIFU TECHNOLOGY INC	3,764	15.590	58,680.76	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	20,996	2.141	44,952.43	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	2,205	33.980	74,925.90	
	AUTOHOME INC-ADR	2,773	30.040	83,300.92	
	IQIYI INC-ADR	13,729	4.630	63,565.27	
	JOYY INC-ADR	1,560	37.800	58,968.00	
KANZHUN LTD - ADR	7,608	14.600	111,076.80		
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	26,103	6.630	173,062.89		
WEIBO CORP-SPON ADR	2,729	12.330	33,648.57		
KE HOLDINGS INC-ADR	23,635	16.660	393,759.10		
アメリカ・ドル小計		310,384		6,136,599.93 (901,896,092)	
香港・ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	51,000	5.750	293,250.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	74,000	9.550	706,700.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	882,000	4.460	3,933,720.00	

CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	121,500	23.650	2,873,475.00	
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	52,000	7.820	406,640.00	
PETROCHINA CO LTD-H	750,000	6.020	4,515,000.00	
YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	72,000	14.040	1,010,880.00	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	110,000	4.390	482,900.00	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	39,000	22.100	861,900.00	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	94,000	7.940	746,360.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	122,000	4.200	512,400.00	
CHINA RESOURCES CEMENT	78,000	2.480	193,440.00	
CMOC GROUP LTD-H	150,000	5.130	769,500.00	
DONGYUE GROUP	43,000	6.440	276,920.00	
GANFENG LITHIUM GROUP CO L-H	14,600	37.500	547,500.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	31,000	12.840	398,040.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	37,000	4.330	160,210.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	25,000	15.280	382,000.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	54,000	10.880	587,520.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	182,000	12.720	2,315,040.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	99,000	3.520	348,480.00	
BOC AVIATION LTD	6,100	58.650	357,765.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	54,000	3.410	184,140.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	56,500	7.750	437,875.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	152,000	4.190	636,880.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	64,000	8.770	561,280.00	
CITIC LTD	193,000	7.570	1,461,010.00	
CRRG CORP LTD - H	144,000	3.870	557,280.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	72,000	4.790	344,880.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	21,000	16.580	348,180.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	39,000	12.760	497,640.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	30,000	14.340	430,200.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	68,000	10.620	722,160.00	
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRI-H	19,400	29.700	576,180.00	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	123,000	2.910	357,930.00	
AIR CHINA LTD-H	56,000	5.680	318,080.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	44,000	3.990	175,560.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	38,140	9.570	364,999.80	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	72,000	4.050	291,600.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	100,400	8.040	807,216.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	66,000	4.620	304,920.00	
JD LOGISTICS INC	70,500	10.300	726,150.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	50,000	6.950	347,500.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	4,000	100.600	402,400.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	49,500	5.320	263,340.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	32,000	5.910	189,120.00	
BYD CO LTD-H	36,500	247.200	9,022,800.00	

DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	70,000	2.930	205,100.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	23,600	35.950	848,420.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	219,000	9.660	2,115,540.00	
GREAT WALL MOTOR CO LTD-H	85,000	9.370	796,450.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	81,200	4.060	329,672.00	
LI AUTO INC-CLASS A	39,600	154.600	6,122,160.00	
MINTH GROUP LTD	22,000	21.950	482,900.00	
XPENG INC - CLASS A SHARES	35,900	73.100	2,624,290.00	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	48,000	15.160	727,680.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	45,400	88.800	4,031,520.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	104,000	3.080	320,320.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	82,000	24.600	2,017,200.00	
LI NING CO LTD	85,000	37.450	3,183,250.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	30,000	76.250	2,287,500.00	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	57,000	7.800	444,600.00	
EAST BUY HOLDING LTD	13,000	37.000	481,000.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	59,000	20.700	1,221,300.00	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	36,000	12.260	441,360.00	
MEITUAN-CLASS B	177,060	125.000	22,132,500.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	52,000	43.150	2,243,800.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	38,400	17.460	670,464.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	29,000	14.160	410,640.00	
TRIP.COM GROUP LTD	19,400	290.800	5,641,520.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	571,500	90.800	51,892,200.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	22,000	5.300	116,600.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	2,300	107.600	247,480.00	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	68,200	11.660	795,212.00	
JD.COM INC-CLASS A	82,285	128.500	10,573,622.50	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	21,000	25.050	526,050.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	49,000	6.270	307,230.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	33,000	23.000	759,000.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	208,000	4.460	927,680.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	40,800	41.350	1,687,080.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	24,200	18.660	451,572.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	3,700	135.800	502,460.00	
CHINA FEIHE LTD	127,000	4.710	598,170.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	113,000	26.600	3,005,800.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	58,000	45.350	2,630,300.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	63,400	43.900	2,783,260.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	58,000	7.720	447,760.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	60,000	11.380	682,800.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	20,000	65.450	1,309,000.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	28,000	5.600	156,800.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	166,000	5.150	854,900.00	

YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	16,000	14.460	231,360.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	25,500	28.300	721,650.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	9,000	18.160	163,440.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	10,800	43.200	466,560.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	23,700	12.440	294,828.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	78,400	7.190	563,696.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	24,700	12.280	303,316.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	42,400	21.000	890,400.00	
3SBIO INC	69,000	6.680	460,920.00	
AKESO INC	15,000	34.550	518,250.00	
BEIGENE LTD	24,700	120.700	2,981,290.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	44,000	11.520	506,880.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	54,500	4.940	269,230.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	86,000	3.000	258,000.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	324,800	5.670	1,841,616.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	36,000	17.860	642,960.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	34,000	10.080	342,720.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	42,500	35.350	1,502,375.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	16,500	18.220	300,630.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	327,000	2.920	954,840.00	
WUXI APPTec CO LTD-H	13,711	80.300	1,100,993.30	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	135,000	41.850	5,649,750.00	
ZAI LAB LTD	29,900	21.450	641,355.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,049,000	2.760	2,895,240.00	
BANK OF CHINA LTD-H	2,795,000	2.690	7,518,550.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	325,000	4.550	1,478,750.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	303,000	3.560	1,078,680.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	3,364,000	4.290	14,431,560.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	77,000	2.260	174,020.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	138,500	32.700	4,528,950.00	
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	265,100	2.570	681,307.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	2,288,000	3.770	8,625,760.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	251,000	3.920	983,920.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	400,000	0.780	312,000.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	132,000	4.120	543,840.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	58,400	14.420	842,128.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	64,500	15.780	1,017,810.00	
FAR EAST HORIZON LTD	42,000	5.340	224,280.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	27,200	11.080	301,376.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	80,800	4.860	392,688.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	43,200	10.460	451,872.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	266,000	12.260	3,261,160.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	96,800	19.380	1,875,984.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	61,000	8.550	521,550.00	



NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	30,100	20.150	606,515.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	308,000	2.740	843,920.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	250,000	9.460	2,365,000.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	235,000	47.850	11,244,750.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	19,800	23.650	468,270.00	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	100,000	5.840	584,000.00	
GDS HOLDINGS LTD-CL A	23,900	11.500	274,850.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	104,000	11.360	1,181,440.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	20,000	14.320	286,400.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	29,000	37.250	1,080,250.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	18,500	18.520	342,620.00	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	21,000	6.280	131,880.00	
LENOVO GROUP LTD	240,000	8.330	1,999,200.00	
SUNNY OPTICAL TECH	26,200	61.700	1,616,540.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	540,600	11.900	6,433,140.00	
ZTE CORP-H	23,800	24.100	573,580.00	
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	17,000	18.420	313,140.00	
GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	642,000	1.330	853,860.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	19,000	19.840	376,960.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	154,000	6.350	977,900.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	1,400,000	0.760	1,064,000.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	17,000	27.900	474,300.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	100,000	1.820	182,000.00	
CGN POWER CO LTD-H	333,000	1.990	662,670.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	94,400	7.770	733,488.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	105,000	6.570	689,850.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	148,000	3.030	448,440.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	29,200	21.750	635,100.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	60,000	15.140	908,400.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	29,000	57.400	1,664,600.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	92,000	6.000	552,000.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	152,000	3.860	586,720.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	122,000	6.210	757,620.00	
BAIDU INC-CLASS A	79,050	137.000	10,829,850.00	
BILIBILI INC-CLASS Z	5,980	116.500	696,670.00	
CHINA LITERATURE LTD	12,200	30.500	372,100.00	
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	172,000	2.130	366,360.00	
KINGSOFT CORP LTD	33,600	29.550	992,880.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	82,100	64.300	5,279,030.00	
NETEASE INC	67,800	155.600	10,549,680.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	233,200	321.600	74,997,120.00	
C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	21,000	20.450	429,450.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	160,000	1.180	188,800.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	138,500	17.180	2,379,430.00	

	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	50,000	9.440	472,000.00	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	114,000	33.850	3,858,900.00	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	23,400	35.050	820,170.00	
	CHINA VANKE CO LTD-H	78,900	9.730	767,697.00	
	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	74,000	9.930	734,820.00	
	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	45,500	9.690	440,895.00	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	63,000	17.420	1,097,460.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	64,600	9.790	632,434.00	
	香港・ドル小計	28,646,026		415,610,756.60 (7,788,545,579)	
台湾・ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	40,000	80.600	3,224,000.00	
	ASIA CEMENT CORP	73,000	39.550	2,887,150.00	
	CHINA STEEL CORP	424,000	26.350	11,172,400.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	128,000	63.500	8,128,000.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	126,000	82.100	10,344,600.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	171,000	67.700	11,576,700.00	
	TAIWAN CEMENT	234,676	34.100	8,002,451.60	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	5,000	926.000	4,630,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	105,000	28.500	2,992,500.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	2,000	1,465.000	2,930,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	108,000	36.500	3,942,000.00	
	CHINA AIRLINES LTD	106,000	22.700	2,406,200.00	
	EVA AIRWAYS CORP	91,000	30.950	2,816,450.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	39,096	107.000	4,183,272.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	64,000	29.450	1,884,800.00	
	WAN HAI LINES LTD	25,605	46.300	1,185,511.50	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	55,000	42.650	2,345,750.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	63,000	41.400	2,608,200.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	6,000	521.000	3,126,000.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	15,276	195.500	2,986,458.00	
	GIANT MANUFACTURING	10,000	190.500	1,905,000.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	6,000	306.000	1,836,000.00	
	POU CHEN	70,000	28.900	2,023,000.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	10,200	666.000	6,793,200.00	
	MOMO.COM INC	2,420	504.000	1,219,680.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	21,000	268.500	5,638,500.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	173,000	70.800	12,248,400.00	
	PHARMAESSENTIA CORP	9,000	358.000	3,222,000.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	189,359	17.400	3,294,846.60	
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	613,000	24.050	14,742,650.00	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	504,360	24.200	12,205,512.00	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	378,501	26.550	10,049,201.55	
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	292,970	20.550	6,020,533.50	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	390,585	36.100	14,100,118.50	

SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	347,551	17.350	6,030,009.85	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	389,912	17.750	6,920,938.00	
TAIWAN BUSINESS BANK	213,032	13.350	2,843,977.20	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	365,563	26.100	9,541,194.30	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	121,299	42.650	5,173,402.35	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	50,832	172.500	8,768,520.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	368,013	24.650	9,071,520.45	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	331,000	46.300	15,325,300.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	536,196	11.950	6,407,542.20	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	271,897	61.800	16,803,234.60	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	414,432	9.560	3,961,969.92	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	18,000	460.500	8,289,000.00	
ACER INC	111,000	37.600	4,173,600.00	
ADVANTECH CO LTD	15,727	345.000	5,425,815.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	25,000	403.500	10,087,500.00	
AUO CORP	222,600	16.550	3,684,030.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	21,000	179.500	3,769,500.00	
COMPAL ELECTRONICS	157,000	31.750	4,984,750.00	
DELTA ELECTRONICS INC	69,000	340.000	23,460,000.00	
E INK HOLDINGS INC	27,000	179.500	4,846,500.00	
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	18,000	307.500	5,535,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	436,800	106.000	46,300,800.00	
INNOLUX CORP	292,163	13.650	3,988,024.95	
INVENTEC CORP	87,000	54.000	4,698,000.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	3,480	1,985.000	6,907,800.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	73,000	134.500	9,818,500.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	27,000	163.500	4,414,500.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	6,000	249.000	1,494,000.00	
PEGATRON CORP	68,000	78.100	5,310,800.00	
QUANTA COMPUTER INC	95,000	242.000	22,990,000.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	37,000	62.300	2,305,100.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	50,000	181.000	9,050,000.00	
WISTRON CORP	88,000	109.000	9,592,000.00	
WIWYNN CORP	3,000	1,555.000	4,665,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	62,520	56.600	3,538,632.00	
YAGEO CORPORATION	10,912	502.000	5,477,824.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	19,000	96.500	1,833,500.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	110,000	116.500	12,815,000.00	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	2,000	1,835.000	3,670,000.00	
GLOBAL UNICHIP CORP	3,000	1,395.000	4,185,000.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	7,000	459.000	3,213,000.00	
MEDIATEK INC	53,000	709.000	37,577,000.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	35,000	67.200	2,352,000.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	19,000	427.500	8,122,500.00	

	PARADE TECHNOLOGIES LTD	3,000	934.000	2,802,000.00	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	103,000	27.600	2,842,800.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	18,000	445.500	8,019,000.00	
	SILERGY CORP	10,800	298.500	3,223,800.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	857,000	539.000	461,923,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	399,000	45.700	18,234,300.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	25,000	69.200	1,730,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	118,000	26.700	3,150,600.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	135,000	116.500	15,727,500.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	51,000	71.600	3,651,600.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	60,000	93.500	5,610,000.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	48,270	34.800	1,679,796.00	
	台湾・ドル小計	12,062,047		1,096,687,766.07 (5,024,145,993)	
エジプト・ ボンド	EASTERN CO SAE	47,271	24.500	1,158,139.50	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BAN	87,802	58.800	5,162,757.60	
	EFG HOLDING S.A.E.	19,906	15.900	316,505.40	
	エジプト・ボンド小計	154,979		6,637,402.50 (31,563,504)	
トルコ・リ ラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	32,627	143.800	4,691,762.60	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	48,657	47.500	2,311,207.50	
	HEKTAS TICARET T.A.S	31,731	26.200	831,352.20	
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	37,677	30.920	1,164,972.84	
	SASA POLYESTER SANAYI	38,018	53.000	2,014,954.00	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	38,582	43.500	1,678,317.00	
	KOC HOLDING AS	26,441	146.600	3,876,250.60	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	47,908	53.900	2,582,241.20	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	1,852	848.000	1,570,496.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	18,832	243.300	4,581,825.60	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	2,571	905.900	2,329,068.90	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	4,752	286.200	1,360,022.40	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	15,813	270.000	4,269,510.00	
	AKBANK T.A.S.	108,288	32.300	3,497,702.40	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	35,457	64.400	2,283,430.80	
	TURKIYE IS BANKASI-C	128,081	24.700	3,163,600.70	
	YAPI VE KREDI BANKASI	117,430	17.260	2,026,841.80	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	42,053	58.950	2,479,024.35		
	トルコ・リラ小計	776,770		46,712,580.89 (256,022,312)	
メキシコ・ ペソ	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	110,600	82.470	9,121,182.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	6,795	227.480	1,545,726.60	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	40,100	38.530	1,545,053.00	
	ALFA S.A.B. -A	126,300	11.450	1,446,135.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	19,800	137.110	2,714,778.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	12,800	308.390	3,947,392.00	

	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	6,600	446.990	2,950,134.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	7,195	165.040	1,187,462.80	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	184,900	66.850	12,360,565.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	17,900	160.740	2,877,246.00	
	GRUMA S.A.B.-B	6,425	286.820	1,842,818.50	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	46,200	83.690	3,866,478.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	47,400	38.310	1,815,894.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	26,900	53.150	1,429,735.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	90,200	143.470	12,940,994.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	67,700	35.830	2,425,691.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER B	661,900	15.860	10,497,734.00	
	OPERADORA DE SITES MEX- A-1	30,400	16.280	494,912.00	
	メキシコ・ペソ小計	1,510,115		75,009,930.90 (627,968,140)	
フィリピン・ペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	42,090	49.000	2,062,410.00	
	AYALA CORPORATION	9,680	624.000	6,040,320.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	82,562	39.100	3,228,174.20	
	SM INVESTMENTS CORP	9,035	824.000	7,444,840.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	38,440	209.400	8,049,336.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	12,830	233.000	2,989,390.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	27,990	116.400	3,258,036.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	66,506	107.000	7,116,142.00	
	BDO UNIBANK INC	82,344	131.200	10,803,532.80	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	58,720	55.000	3,229,600.00	
	PLDT INC	2,690	1,200.000	3,228,000.00	
	ACEN CORP	10,485	5.010	52,529.85	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	10,060	349.200	3,512,952.00	
	AYALA LAND INC	237,900	28.800	6,851,520.00	
SM PRIME HOLDINGS INC	366,400	30.000	10,992,000.00		
	フィリピン・ペソ小計	1,057,732		78,858,782.85 (204,614,884)	
チリ・ペソ	EMPRESAS COPEC SA	13,877	5,923.200	82,196,246.40	
	EMPRESAS CMPC SA	36,662	1,537.700	56,375,157.40	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	5,151	53,155.000	273,801,405.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	374,056	55.750	20,853,622.00	
	FALABELLA SA	28,182	2,050.000	57,773,100.00	
	CENCOSUD SA	40,071	1,782.000	71,406,522.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	5,381	6,175.000	33,227,675.00	
	BANCO DE CHILE	1,530,852	89.100	136,398,913.20	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	2,223	23,560.000	52,373,880.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	2,408,919	39.890	96,091,778.91	
	ENEL AMERICAS SA	843,379	99.220	83,680,064.38	
ENEL CHILE SA	971,320	53.800	52,257,016.00		
	チリ・ペソ小計	6,260,073		1,016,435,380.29 (166,524,640)	

コロンビア・ペソ	BANCOLOMBIA SA	9,763	28,300.000	276,292,900.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	15,218	25,680.000	390,798,240.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	14,643	14,300.000	209,394,900.00	
コロンビア・ペソ小計		39,624		876,486,040.00 (32,069,748)	
インド・ルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	25,859	361.950	9,359,665.05	
	COAL INDIA LTD	52,468	282.100	14,801,222.80	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	15,734	260.400	4,097,133.60	
	INDIAN OIL CORP LTD	89,126	94.000	8,377,844.00	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	106,477	184.450	19,639,682.65	
	PETRONET LNG LTD	27,436	250.200	6,864,487.20	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	105,896	2,448.200	259,254,587.20	
	AMBUJA CEMENTS LTD	19,152	439.200	8,411,558.40	
	ASIAN PAINTS LTD	13,624	3,238.050	44,115,193.20	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	6,933	716.900	4,970,267.70	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	8,842	1,849.750	16,355,489.50	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	41,646	476.150	19,829,742.90	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	11,377	698.300	7,944,559.10	
	JSW STEEL LTD	19,429	815.750	15,849,206.75	
	PI INDUSTRIES LTD	2,663	3,655.500	9,734,596.50	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	4,812	2,505.050	12,054,300.60	
	SHREE CEMENT LTD	324	25,973.100	8,415,284.40	
	SRF LTD	5,058	2,440.300	12,343,037.40	
	SUPREME INDUSTRIES LTD	2,423	4,628.650	11,215,218.95	
	TATA STEEL LTD	262,781	129.500	34,030,139.50	
	ULTRATECH CEMENT LTD	4,130	8,430.550	34,818,171.50	
	UPL LTD	15,397	606.800	9,342,899.60	
	VEDANTA LTD	20,729	237.750	4,928,319.75	
	ABB INDIA LTD	2,065	4,458.550	9,206,905.75	
	ADANI ENTERPRISES LTD	5,498	2,519.300	13,851,111.40	
	ASHOK LEYLAND LTD	56,114	183.600	10,302,530.40	
	ASTRAL LTD	4,691	1,909.300	8,956,526.30	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	134,202	143.300	19,231,146.60	
	CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	19,270	455.250	8,772,667.50	
	CUMMINS INDIA LTD	5,373	1,755.350	9,431,495.55	
	HAVELLS INDIA LTD	9,425	1,450.250	13,668,606.25	
	HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	2,687	4,105.550	11,031,612.85	
	LARSEN & TOUBRO LTD	24,291	2,901.600	70,482,765.60	
SIEMENS LTD	2,862	3,945.600	11,292,307.20		
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	6,819	725.550	4,947,525.45		
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	19,519	825.000	16,103,175.00		
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	10,064	708.900	7,134,369.60		
INTERGLOBE AVIATION LTD	4,338	2,473.500	10,730,043.00		
BAJAJ AUTO LTD	2,566	4,759.550	12,213,005.30		

BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	2,486	2,402.400	5,972,366.40	
BHARAT FORGE LTD	8,900	1,105.400	9,838,060.00	
EICHER MOTORS LTD	4,755	3,370.900	16,028,629.50	
HERO MOTOCORP LTD	3,820	3,008.750	11,493,425.00	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	32,414	1,567.550	50,810,565.70	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	4,723	10,332.000	48,798,036.00	
MRF LTD	70	108,858.400	7,620,088.00	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	74,623	99.550	7,428,719.65	
SONA BLW PRECISION FORGINGS	13,173	591.900	7,797,098.70	
TATA MOTORS LTD	57,726	627.250	36,208,633.50	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	3,415	3,313.000	11,313,895.00	
TVS MOTOR CO LTD	7,637	1,480.550	11,306,960.35	
PAGE INDUSTRIES LTD	194	41,858.000	8,120,452.00	
TITAN CO LTD	12,654	3,199.100	40,481,411.40	
INDIAN HOTELS CO LTD	27,400	429.550	11,769,670.00	
JUBILANT FOODWORKS LTD	14,355	532.700	7,646,908.50	
ZOMATO LTD	137,493	99.600	13,694,302.80	
TRENT LTD	6,771	2,086.550	14,128,030.05	
AVENUE SUPERMARTS LTD	5,654	3,782.400	21,385,689.60	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	3,767	4,540.500	17,104,063.50	
ITC LTD	105,944	442.650	46,896,111.60	
MARICO LTD	18,008	586.650	10,564,393.20	
NESTLE INDIA LTD	1,217	21,883.250	26,631,915.25	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	18,760	853.100	16,004,156.00	
UNITED SPIRITS LTD	10,302	1,055.200	10,870,670.40	
VARUN BEVERAGES LTD	15,648	909.900	14,238,115.20	
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	4,747	2,015.400	9,567,103.80	
DABUR INDIA LTD	21,140	567.100	11,988,494.00	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	14,218	1,020.300	14,506,625.40	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	28,964	2,513.800	72,809,703.20	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	3,236	4,985.150	16,131,945.40	
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	24,969	603.000	15,056,307.00	
AUROBINDO PHARMA LTD	8,477	858.500	7,277,504.50	
CIPLA LTD	19,015	1,244.600	23,666,069.00	
DIVI 'S LABORATORIES LTD	3,911	3,698.800	14,466,006.80	
DR. REDDY'S LABORATORIES	3,932	5,583.800	21,955,501.60	
LUPIN LTD	6,582	1,128.600	7,428,445.20	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	34,226	1,130.450	38,690,781.70	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	3,264	1,872.750	6,112,656.00	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	6,667	734.900	4,899,578.30	
AXIS BANK LTD	79,208	980.300	77,647,602.40	
BANDHAN BANK LTD	26,591	243.400	6,472,249.40	
BANK OF BARODA	38,009	197.800	7,518,180.20	
HDFC BANK LIMITED	96,928	1,623.400	157,352,915.20	

	ICICI BANK LTD	179,956	970.550	174,656,295.80	
	IDFC FIRST BANK LTD	112,874	95.350	10,762,535.90	
	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	38,079	1,793.200	68,283,262.80	
	STATE BANK OF INDIA	62,035	583.450	36,194,320.75	
	YES BANK LTD	449,730	18.350	8,252,545.50	
	BAJAJ FINANCE LTD	9,476	7,410.650	70,223,319.40	
	BAJAJ FINSERV LTD	13,269	1,541.000	20,447,529.00	
	BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	859	7,141.800	6,134,806.20	
	CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	14,064	1,175.950	16,538,560.80	
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	2,968	2,535.800	7,526,254.40	
	JIO FINANCIAL SERVICES LTD	105,812	253.200	26,791,598.40	
	MUTHOOT FINANCE LTD	4,186	1,284.200	5,375,661.20	
	POWER FINANCE CORPORATION	36,701	305.100	11,197,475.10	
	REC LTD	45,100	270.150	12,183,765.00	
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	10,068	839.900	8,456,113.20	
	SHRIRAM FINANCE LTD	10,283	1,953.850	20,091,439.55	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	33,620	657.450	22,103,469.00	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	7,594	1,349.000	10,244,306.00	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	12,502	556.700	6,959,863.40	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	15,655	1,341.450	21,000,399.75	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	33,762	1,262.050	42,609,332.10	
	INFOSYS LTD	116,069	1,469.600	170,575,002.40	
	LTIMINDTREE LTD	3,273	5,478.500	17,931,130.50	
	MPHASIS LTD	2,360	2,466.150	5,820,114.00	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	31,793	3,441.900	109,428,326.70	
	TATA ELXSI LTD	1,081	7,366.200	7,962,862.20	
	TECH MAHINDRA LTD	19,431	1,262.950	24,540,381.45	
	WIPRO LTD	43,286	430.000	18,612,980.00	
	BHARTI AIRTEL LTD	78,764	885.850	69,773,089.40	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	12,008	1,001.200	12,022,409.60	
	ADANI POWER LTD	24,800	369.150	9,154,920.00	
	GAIL INDIA LTD	71,754	128.050	9,188,099.70	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	11,856	481.750	5,711,628.00	
	NTPC LTD	156,030	240.250	37,486,207.50	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	125,117	258.650	32,361,512.05	
	TATA POWER CO LTD	53,868	268.850	14,482,411.80	
	INFO EDGE INDIA LTD	2,239	4,477.750	10,025,682.25	
	DLF LTD	21,945	540.000	11,850,300.00	
	GODREJ PROPERTIES LTD	4,022	1,693.250	6,810,251.50	
	インド・ルピー小計	4,166,382		2,991,578,600.70 (5,325,009,908)	
インドネシ ア・ルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBK P	454,200	2,890.000	1,312,638,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	46,800	27,300.000	1,277,640,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	303,800	1,945.000	590,891,000.00	



	BARITO PACIFIC TBK PT	891,211	1,140.000	1,015,980,540.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	90,200	9,450.000	852,390,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	380,461	3,210.000	1,221,279,810.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	91,200	6,925.000	631,560,000.00	
	VALE INDONESIA TBK	103,800	5,875.000	609,825,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	731,200	6,400.000	4,679,680,000.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	30,787,100	93.000	2,863,200,300.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	524,200	2,870.000	1,504,454,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	260,300	4,910.000	1,278,073,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	71,100	11,125.000	790,987,500.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	143,900	6,925.000	996,507,500.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	240,800	3,610.000	869,288,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	665,700	1,720.000	1,145,004,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,947,400	9,125.000	17,770,025,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	1,327,300	5,900.000	7,831,070,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	249,100	9,375.000	2,335,312,500.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	2,392,400	5,350.000	12,799,340,000.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	878,600	1,045.000	918,137,000.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	1,768,600	3,690.000	6,526,134,000.00	
	インドネシア・ルピア小計	44,349,372		69,819,417,150.00 (670,266,405)	
ブラジル・ レアル	COSAN SA	42,588	17.320	737,624.16	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	130,900	36.710	4,805,339.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	167,300	33.400	5,587,820.00	
	PRIO SA	27,800	47.490	1,320,222.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	26,800	18.380	492,584.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	20,900	11.930	249,337.00	
	GERDAU SA-PREF	42,440	25.310	1,074,156.40	
	SUZANO SA	28,415	48.800	1,386,652.00	
	VALE SA	119,188	66.710	7,951,031.48	
	WEG SA	59,960	35.400	2,122,584.00	
	CCR SA	32,700	12.260	400,902.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	32,230	60.350	1,945,080.50	
	RUMO SA	47,600	22.080	1,051,008.00	
	LOJAS RENNER S.A.	29,658	15.520	460,292.16	
	MAGAZINE LUIZA SA	110,400	2.510	277,104.00	
	VIBRA ENERGIA SA	40,280	18.230	734,304.40	
	ATACADA0 SA	19,900	10.170	202,383.00	
	RAIA DROGASIL SA	43,280	26.810	1,160,336.80	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	43,700	12.230	534,451.00	
	AMBEV SA	168,300	13.700	2,305,710.00	
	JBS SA	23,700	18.430	436,791.00	
NATURA &CO HOLDING SA	28,400	14.760	419,184.00		
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	174,519	4.370	762,648.03		

	REDE D'OR SAO LUIZ SA	20,200	28.250	570,650.00	
	HYPERA SA	13,000	38.450	499,850.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	59,481	12.800	761,356.80	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	184,636	14.380	2,655,065.68	
	BANCO DO BRASIL S.A.	31,100	46.640	1,450,504.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	168,400	26.770	4,508,068.00	
	ITAUSA SA	2,239	2.670	5,978.13	
	ITAUSA SA	179,505	9.010	1,617,340.05	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	202,200	12.540	2,535,588.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	26,200	31.110	815,082.00	
	TOTVS SA	18,400	27.700	509,680.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	13,500	41.860	565,110.00	
	TIM SA	29,400	14.440	424,536.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	43,705	34.370	1,502,140.85	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	8,000	37.650	301,200.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	43,899	12.160	533,811.84	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	10,800	57.680	622,944.00	
	CPFL ENERGIA SA	7,300	34.130	249,149.00	
	ENEVA SA	32,200	11.760	378,672.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	6,450	41.360	266,772.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	33,100	31.150	1,031,065.00	
	ブラジル・リアル小計	2,594,673		58,222,108.28 (1,715,828,820)	
チェコ・コ ルナ	KOMERCNI BANKA AS	2,214	679.500	1,504,413.00	
	MONETA MONEY BANK AS	12,093	82.600	998,881.80	
	CEZ AS	5,878	925.000	5,437,150.00	
	チェコ・コルナ小計	20,185		7,940,444.80 (51,226,986)	
韓国・ウォ ン	HD HYUNDAI	1,340	67,500.000	90,450,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	2,157	171,000.000	368,847,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD-RIGHTS	136	37,850.000	5,147,600.00	
	S-OIL CORP	1,775	78,000.000	138,450,000.00	
	ECOPRO CO LTD	707	1,021,000.000	721,847,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	3,543	33,400.000	118,336,200.00	
	HYUNDAI STEEL CO	2,767	38,950.000	107,774,650.00	
	KOREA ZINC CO LTD	285	540,000.000	153,900,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	531	129,200.000	68,605,200.00	
	LG CHEM LTD	1,744	564,000.000	983,616,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	227	331,500.000	75,250,500.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	723	139,300.000	100,713,900.00	
	POSCO HOLDINGS INC	2,525	583,000.000	1,472,075,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	960	82,700.000	79,392,000.00	
	SKC CO LTD	496	84,100.000	41,713,600.00	
DOOSAN BOBCAT INC	2,210	52,900.000	116,909,000.00		

DOOSAN ENERBILITY CO LTD	15,235	16,850.000	256,709,750.00	
ECOPRO BM CO LTD	1,748	299,000.000	522,652,000.00	
GS HOLDINGS	1,178	39,700.000	46,766,600.00	
HANWHA AEROSPACE CO LTD	1,139	117,300.000	133,604,700.00	
HANWHA OCEAN CO LTD	1,903	34,600.000	65,843,800.00	
HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	830	125,200.000	103,916,000.00	
HD KOREA SHIPBUILDING & OFFS	1,365	118,800.000	162,162,000.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	2,816	35,900.000	101,094,400.00	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	668	87,200.000	58,249,600.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	2,283	50,300.000	114,834,900.00	
LG CORP	3,469	83,900.000	291,049,100.00	
LG ENERGY SOLUTION	1,655	509,000.000	842,395,000.00	
POSCO FUTURE M CO LTD	1,037	418,000.000	433,466,000.00	
POSCO INTERNATIONAL CORP	1,697	80,000.000	135,760,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	2,774	107,900.000	299,314,600.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	5,041	33,050.000	166,605,050.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	21,785	8,230.000	179,290,550.00	
SK INC	1,219	146,900.000	179,071,100.00	
SK SQUARE CO LTD	3,184	41,750.000	132,932,000.00	
HMM CO LTD	7,862	16,810.000	132,160,220.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	741	172,900.000	128,118,900.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	6,388	22,750.000	145,327,000.00	
PAN OCEAN CO LTD	10,467	4,285.000	44,851,095.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	2,114	38,800.000	82,023,200.00	
HANON SYSTEMS	8,177	9,020.000	73,756,540.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	2,130	235,500.000	501,615,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	4,779	185,700.000	887,460,300.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	1,296	101,100.000	131,025,600.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	913	99,900.000	91,208,700.00	
KIA CORP	9,082	77,800.000	706,579,600.00	
COWAY CO LTD	1,996	42,000.000	83,832,000.00	
F&F CO LTD / NEW	502	112,600.000	56,525,200.00	
LG ELECTRONICS INC	3,852	98,800.000	380,577,600.00	
KANGWON LAND INC	3,691	15,800.000	58,317,800.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	1,159	88,100.000	102,107,900.00	
BGF RETAIL CO LTD	193	153,600.000	29,644,800.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	261	297,500.000	77,647,500.00	
KT&G CORP	3,477	88,500.000	307,714,500.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	694	123,400.000	85,639,600.00	
AMOREPACIFIC CORP	1,133	130,100.000	147,403,300.00	
LG H&H	359	462,500.000	166,037,500.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	3,439	66,000.000	226,974,000.00	
HLB INC	4,048	28,500.000	115,368,000.00	
CELLTRION INC	3,921	147,500.000	578,347,500.00	

CELLTRION PHARM INC	364	69,300.000	25,225,200.00	
HANMI PHARM CO LTD	174	298,500.000	51,939,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	639	724,000.000	462,636,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	1,033	81,900.000	84,602,700.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	902	72,900.000	65,755,800.00	
YUHAN CORP	1,951	73,000.000	142,423,000.00	
HANA FINANCIAL GROUP	10,681	40,150.000	428,842,150.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	11,154	10,920.000	121,801,680.00	
KAKAOBANK CORP	5,365	24,950.000	133,856,750.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	13,323	54,100.000	720,774,300.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	15,313	35,750.000	547,439,750.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	22,480	12,000.000	269,760,000.00	
KAKAOPAY CORP	839	44,550.000	37,377,450.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	1,369	53,100.000	72,693,900.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	3,907	55,000.000	214,885,000.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	8,457	6,890.000	58,268,730.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	5,391	10,290.000	55,473,390.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	2,379	37,350.000	88,855,650.00	
DB INSURANCE CO LTD	1,789	84,800.000	151,707,200.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	1,033	259,000.000	267,547,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	2,525	68,400.000	172,710,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	1,205	147,200.000	177,376,000.00	
COSMOAM&T CO LTD	821	152,100.000	124,874,100.00	
COSMOAM&T CO LTD-RIGHTS	43	36,270.000	1,559,610.00	
L&F CO LTD	811	197,200.000	159,929,200.00	
LG DISPLAY CO LTD	7,290	13,090.000	95,426,100.00	
LG INNOTEK CO LTD	495	244,500.000	121,027,500.00	
LOTTE ENERGY MATERIALS CORP	643	44,550.000	28,645,650.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1,801	139,200.000	250,699,200.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	166,216	70,300.000	11,684,984,800.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	28,599	57,100.000	1,633,002,900.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	1,912	589,000.000	1,126,168,000.00	
HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	1,522	54,200.000	82,492,400.00	
SK HYNIX INC	19,106	113,700.000	2,172,352,200.00	
KT CORP	2,098	32,350.000	67,870,300.00	
LG UPLUS CORP	6,942	10,370.000	71,988,540.00	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	9,785	18,420.000	180,239,700.00	
HYBE CO LTD	587	245,500.000	144,108,500.00	
JYP ENTERTAINMENT CORP	1,121	107,700.000	120,731,700.00	
KAKAO CORP	11,126	48,250.000	536,829,500.00	
KAKAO GAMES CORP	1,454	27,600.000	40,130,400.00	
KRAFTON INC	1,009	153,600.000	154,982,400.00	
NAVER CORP	4,633	215,000.000	996,095,000.00	
NCSOFT CORP	485	244,500.000	118,582,500.00	

	NETMARBLE CORP	678	42,500.000	28,815,000.00	
	PEARL ABYSS CORP	1,209	49,450.000	59,785,050.00	
	韓国・ウォン小計	558,485		38,562,279,055.00 (4,249,563,151)	
マレーシア・リンギット	DIALOG GROUP BHD	135,200	2.100	283,920.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	7,300	22.700	165,710.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	105,000	7.170	752,850.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	140,100	4.890	685,089.00	
	GAMUDA BHD	57,800	4.340	250,852.00	
	SIME DARBY BERHAD	93,800	2.190	205,422.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	30,900	7.250	224,025.00	
	MISC BHD	42,800	7.150	306,020.00	
	GENTING BHD	60,200	4.300	258,860.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	124,300	2.590	321,937.00	
	MR DIY GROUP M BHD	136,150	1.520	206,948.00	
	IOI CORP BHD	101,000	4.050	409,050.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	13,900	21.200	294,680.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	2,300	130.000	299,000.00	
	PPB GROUP BERHAD	20,240	15.720	318,172.80	
	QL RESOURCES BHD	29,250	5.500	160,875.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	59,300	4.290	254,397.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	85,700	5.900	505,630.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	68,900	3.670	252,863.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	215,700	5.690	1,227,333.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	22,700	19.800	449,460.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	5,700	17.900	102,030.00	
	MALAYAN BANKING BHD	194,500	9.140	1,777,730.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	518,100	4.250	2,201,925.00	
	RHB BANK BHD	48,000	5.660	271,680.00	
	INARI AMERTRON BHD	92,100	2.870	264,327.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	89,500	2.450	219,275.00	
CELCOMDIGI BHD	123,800	4.360	539,768.00		
MAXIS BHD	85,300	4.190	357,407.00		
TELEKOM MALAYSIA BHD	34,000	5.200	176,800.00		
PETRONAS GAS BHD	30,700	17.120	525,584.00		
TENAGA NASIONAL BHD	84,900	9.860	837,114.00		
	マレーシア・リンギット小計	2,859,140		15,106,733.80 (475,059,946)	
南アフリカ・ランド	EXXARO RESOURCES LTD	7,716	171.670	1,324,605.72	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	3,545	156.900	556,210.50	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	2,321	596.500	1,384,476.50	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	15,268	322.810	4,928,663.08	
	GOLD FIELDS LTD	31,972	237.870	7,605,179.64	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	18,015	80.000	1,441,200.00	

	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	32,232	82.990	2,674,933.68	
	KUMBA IRON ORE LTD	2,544	405.500	1,031,592.00	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	14,047	105.670	1,484,346.49	
	SASOL LTD	20,736	244.430	5,068,500.48	
	SIBANYE STILLWATER LTD	89,325	25.870	2,310,837.75	
	BIDVEST GROUP LTD	9,128	267.010	2,437,267.28	
	NASPERS LTD-N SHS	6,820	3,192.340	21,771,758.80	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	70,079	15.490	1,085,523.71	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	32,847	72.500	2,381,407.50	
	BID CORP LTD	12,198	456.180	5,564,483.64	
	CLICKS GROUP LTD	7,700	266.860	2,054,822.00	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	18,303	253.840	4,646,033.52	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	11,970	164.570	1,969,902.90	
	ABSA GROUP LTD	29,464	180.630	5,322,082.32	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,026	1,712.680	5,182,569.68	
	NEDBANK GROUP LTD	14,528	211.010	3,065,553.28	
	STANDARD BANK GROUP LTD	46,594	192.300	8,960,026.20	
	FIRSTRAND LTD	175,462	71.900	12,615,717.80	
	REINET INVESTMENTS SCA	4,918	405.340	1,993,462.12	
	REMGRO LTD	16,702	156.950	2,621,378.90	
	DISCOVERY LTD	18,855	145.390	2,741,328.45	
	OLD MUTUAL LTD	170,915	12.690	2,168,911.35	
	OUTSURANCE GROUP LTD	26,578	39.940	1,061,525.32	
	SANLAM LTD	61,250	68.750	4,210,937.50	
	MTN GROUP LTD	58,939	122.240	7,204,703.36	
	VODACOM GROUP LTD	21,750	110.060	2,393,805.00	
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	14,414	113.180	1,631,376.52	
	南アフリカ・ランド小計	1,070,161		132,895,122.99 (1,021,963,496)	
タイ・パ ーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	253,400	8.250	2,090,550.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	46,200	167.500	7,738,500.00	
	PTT PCL-NVDR	359,000	35.000	12,565,000.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	33,900	48.750	1,652,625.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	54,400	27.500	1,496,000.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	78,600	36.000	2,829,600.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	41,600	39.250	1,632,800.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	25,700	311.000	7,992,700.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	154,600	71.000	10,976,600.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR	221,600	8.600	1,905,760.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	229,500	7.150	1,640,925.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	184,500	4.140	763,830.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	126,300	32.750	4,136,325.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	50,491	41.250	2,082,753.75	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	235,400	13.600	3,201,440.00	

	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	110,600	20.000	2,212,000.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	42,800	33.250	1,423,100.00	
	CP ALL PCL-NVDR	209,200	64.250	13,441,100.00	
	CP AXTRA PCL-NVDR	77,100	35.750	2,756,325.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	154,600	21.200	3,277,520.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	38,500	29.250	1,126,125.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	401,400	27.250	10,938,150.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	22,300	255.000	5,686,500.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	23,700	129.500	3,069,150.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	103,500	19.300	1,997,550.00	
	SCB X PCL-NVDR	30,600	116.000	3,549,600.00	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	1,077,800	1.730	1,864,594.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	27,100	47.500	1,287,250.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	16,200	40.500	656,100.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	112,100	105.500	11,826,550.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	39,300	216.000	8,488,800.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	35,900	72.750	2,611,725.00	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	333,267	7.050	2,349,532.35	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	20,900	32.750	684,475.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	10,400	131.500	1,367,600.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	57,500	60.750	3,493,125.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	27,400	51.250	1,404,250.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	99,400	46.750	4,646,950.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	37,900	34.000	1,288,600.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	76,200	67.250	5,124,450.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	233,200	8.400	1,958,880.00	
	タイ・パーツ小計	5,514,058		161,235,410.10 (667,514,598)	
ポーランド・ズロチ	ORLEN SA	20,938	58.630	1,227,594.94	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	4,782	110.300	527,454.60	
	BUDIMEX	546	417.500	227,955.00	
	LPP SA	35	13,450.000	470,750.00	
	ALLEGRO.EU SA	17,996	31.795	572,182.82	
	PEPCO GROUP NV	5,020	30.940	155,318.80	
	DINO POLSKA SA	1,669	383.800	640,562.20	
	BANK PEKAO SA	6,831	99.940	682,690.14	
	MBANK SA	477	398.700	190,179.90	
	PKO BANK POLSKI SA	29,089	35.170	1,023,060.13	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	1,143	355.000	405,765.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	20,323	39.150	795,645.45	
	PGE SA	36,813	7.566	278,527.15	
	CD PROJEKT SA	2,415	154.100	372,151.50	
CYFROWY POLSAT SA	5,742	13.415	77,028.93		
	ポーランド・ズロチ小計	153,819		7,646,866.56	

				(260,775,736)	
ハンガリー・フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	14,232	2,668.000	37,970,976.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	5,283	9,395.000	49,633,785.00	
	OTP BANK PLC	8,272	14,340.000	118,620,480.00	
ハンガリー・フォリント小計		27,787		206,225,241.00 (84,390,256)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	2,780	23.420	65,107.60	
	MYTILINEOS S.A.	3,556	35.160	125,028.96	
	FF GROUP	123	4.800	590.40	
	OPAP SA	6,174	16.310	100,697.94	
	JUMBO SA	3,650	27.700	101,105.00	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	70,399	1.397	98,347.40	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	97,148	1.494	145,139.11	
	NATIONAL BANK OF GREECE	20,783	5.940	123,451.02	
	PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS S	27,191	3.100	84,292.10	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	6,284	13.590	85,399.56	
	PUBLIC POWER CORP	6,630	9.625	63,813.75	
ユーロ小計		244,718		992,972.84 (156,373,363)	
合計		112,376,530		29,711,323,555 (29,711,323,555)	

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

通貨	銘柄数		組入株式時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	株式	24銘柄	2.5%	3.0%
香港・ドル	株式	187銘柄	21.4%	26.2%
台湾・ドル	株式	90銘柄	13.8%	16.9%
エジプト・ポンド	株式	3銘柄	0.1%	0.1%
トルコ・リラ	株式	18銘柄	0.7%	0.9%
メキシコ・ペソ	株式	18銘柄	1.7%	2.1%
フィリピン・ペソ	株式	15銘柄	0.6%	0.7%
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	122銘柄	14.6%	17.9%
インドネシア・ルピア	株式	22銘柄	1.8%	2.3%
ブラジル・リアル	株式	44銘柄	4.7%	5.8%
チェコ・コルナ	株式	3銘柄	0.1%	0.2%
韓国・ウォン	株式	106銘柄	11.7%	14.3%
マレーシア・リンギット	株式	32銘柄	1.3%	1.6%
南アフリカ・ランド	株式	33銘柄	2.8%	3.4%
タイ・バーツ	株式	41銘柄	1.8%	2.2%
ポーランド・ズロチ	株式	15銘柄	0.7%	0.9%
ハンガリー・フォリント	株式	3銘柄	0.2%	0.3%
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	2,095,800.00	81,484,704.00		
		オフショア・人民元小計	2,095,800.00	81,484,704.00 (1,628,023,643)		
投資信託受益証券合計				1,628,023,643 (1,628,023,643)		
投資証券	アメリカ・ドル	ISHARES MSCI KUWAIT ETF	59,959.00	1,893,505.22		
		ISHARES MSCI QATAR ETF	118,705.00	2,105,826.70		
		ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	240,096.00	9,603,840.00		
		ISHARES MSCI UAE ETF	204,010.00	3,051,989.60		
	アメリカ・ドル小計			622,770.00	16,655,161.52 (2,447,809,089)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB-CPO	535,300.00	6,809,016.00		
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	16,575.00	2,379,838.50		
		FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	67,700.00	12,836,597.00		
		GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	74,700.00	1,033,101.00		
		TRUST FIBRA UNO	99,100.00	2,859,035.00		
	メキシコ・ペソ小計			793,375.00	25,917,587.50 (216,976,859)	
	ブラジル・レアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	42,700.00	1,309,182.00		
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	10,500.00	278,250.00		
		ENERGISA SA-UNITS	6,900.00	313,812.00		
		KLABIN SA - UNIT	23,300.00	515,163.00		
	ブラジル・レアル小計			83,400.00	2,416,407.00 (71,212,481)	
	南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	137,279.00	1,617,146.62		
南アフリカ・ランド小計		137,279.00	1,617,146.62 (12,435,858)			
投資証券合計				2,748,434,286 (2,748,434,286)		
合計				4,376,457,929 (4,376,457,929)		

(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	-	6.7%	55.9%
メキシコ・ペソ	投資証券 5銘柄	-	0.6%	5.0%
ブラジル・レアル	投資証券 4銘柄	-	0.2%	1.6%

オフショア・人民元	投資信託受益証券	1銘柄	4.5%	-	37.2%
南アフリカ・ランド	投資証券	1銘柄	-	0.0%	0.3%

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

## Jリート・インデックス・マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2022年9月12日現在)	(2023年9月11日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,734,473	1,079,562
コール・ローン	48,750,235	45,701,297
投資証券	9,847,729,000	13,183,983,800
派生商品評価勘定	283,600	-
未収配当金	114,103,009	172,193,896
差入委託証拠金	2,350,000	2,290,000
流動資産合計	10,014,950,317	13,405,248,555
資産合計	10,014,950,317	13,405,248,555
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	268,400
前受金	208,000	56,000
未払解約金	729,780	14,462,955
その他未払費用	479	1,380
流動負債合計	938,259	14,788,735
負債合計	938,259	14,788,735
純資産の部		
元本等		
元本	3,618,768,466	4,995,462,169
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	6,395,243,592	8,394,997,651
元本等合計	10,014,012,058	13,390,459,820
純資産合計	10,014,012,058	13,390,459,820
負債純資産合計	10,014,950,317	13,405,248,555

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年9月13日 至 2023年9月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。

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

（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9月12日現在）	（2023年9月11日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	3,618,768,466口	4,995,462,169口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.7672円 （1万口当たりの純資産額27,672円）	1口当たり純資産額 2.6805円 （1万口当たりの純資産額26,805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9月13日 至 2023年9月11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、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p>

	<p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
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9月11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9月12日現在）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

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

（2023年9月11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	-	37,510,000	268,400
	小計	37,778,400	-	37,510,000	268,400
合 計		37,778,400	-	37,510,000	268,400

## （注）1．時価の算定方法

リート指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2)リート指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

自 2022年9月13日 至 2023年9月11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9月12日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	2,675,035,456円
同期中における追加設定元本額	2,538,256,373円
同期中における一部解約元本額	1,594,523,363円

## 2022年9月12日現在の元本の内訳

アセットアロケーション・ファンド（安定型）	69,933,114円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	138,890,778円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	107,176,523円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	2,119,488,327円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	16,140,629円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	57,002,092円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	42,983,263円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	148,291,027円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	83,664,634円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	65,470,159円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	28,910,457円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,245,677円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	85,939,337円
日興FWS・Jリートインデックス	305,206,603円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	20,225,759円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	3,493,800円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	63,085,945円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	48,115,503円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	61,060,756円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105（リスク3%） <適格機関投資家限定>	151,444,083円
合計	3,618,768,466円

(2023年9月11日現在)

## 開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	3,618,768,466円
同期中における追加設定元本額	2,796,296,809円
同期中における一部解約元本額	1,419,603,106円

## 2023年9月11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）	235,220,778円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	316,152,868円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	142,329,717円
イオン・バランス戦略ファンド	65,920,793円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	2,510,623,916円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	19,066,545円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	39,063,929円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	38,725,679円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	160,007,336円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	98,903,746円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	74,867,373円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	39,990,515円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,447,550円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	233,155,759円
日興FWS・Jリートインデックス	589,430,782円

三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	60,690,538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)	122,781円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	1,912,971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)	9,735,376円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	5,209,846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)	3,448,069円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	3,148,468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>	79,713,693円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	49,281,384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>	79,401,552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>	136,795,174円
合計	4,995,462,169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	247	29,541,200	
	サンケイリアルエステート投資法人	394	37,627,000	
	SOSILA物流リート投資法人	616	79,402,400	
	東海道リート投資法人	180	22,554,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	426	275,196,000	
	森ヒルズリート投資法人	1,451	214,022,500	
	産業ファンド投資法人	1,884	274,687,200	
	アドバンス・レジデンス投資法人	1,172	400,824,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	906	204,574,800	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	647	267,211,000	
	GLP投資法人	4,166	577,407,600	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	607	201,524,000	
	日本プロロジスリート投資法人	2,148	614,113,200	
	星野リゾート・リート投資法人	227	147,096,000	
	Oneリート投資法人	213	55,656,900	
イオンリート投資法人	1,514	224,526,200		

ヒューリックリート投資法人	1,156	189,237,200	
日本リート投資法人	399	140,847,000	
積水ハウス・リート投資法人	3,709	313,781,400	
トーセイ・リート投資法人	256	35,916,800	
ケネディクス商業リート投資法人	536	154,100,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	300	45,240,000	
サムティ・レジデンシャル投資法人	326	37,555,200	
野村不動産マスターファンド投資法人	3,987	676,593,900	
いちごホテルリート投資法人	200	23,460,000	
ラサールロジポート投資法人	1,579	230,691,900	
スターアジア不動産投資法人	1,891	107,597,900	
マリモ地方創生リート投資法人	186	23,770,800	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	513	250,600,500	
大江戸温泉リート投資法人	186	11,997,000	
投資法人みらい	1,580	74,813,000	
三菱地所物流リート投資法人	425	165,537,500	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	530	89,464,000	
ザイマックス・リート投資法人	195	22,795,500	
タカラレーベン不動産投資法人	586	57,603,800	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	541	70,167,700	
日本ビルファンド投資法人	1,438	874,304,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	1,266	750,738,000	
日本都市ファンド投資法人	5,911	575,731,400	
オリックス不動産投資法人	2,458	444,160,600	
日本プライムリアルティ投資法人	844	314,812,000	
N T T 都市開発リート投資法人	1,186	165,921,400	
東急リアル・エステート投資法人	828	154,339,200	
グローバル・ワン不動産投資法人	912	108,345,600	
ユナイテッド・アーバン投資法人	2,759	432,335,300	
森トラストリート投資法人	2,381	179,527,400	
インヴィンシブル投資法人	5,975	381,205,000	
フロンティア不動産投資法人	456	215,004,000	
平和不動産リート投資法人	922	136,363,800	
日本ロジスティクスファンド投資法人	790	238,580,000	
福岡リート投資法人	638	104,057,800	
ケネディクス・オフィス投資法人	718	245,556,000	
いちごオフィスリート投資法人	1,012	90,472,800	
大和証券オフィス投資法人	250	171,250,000	
阪急阪神リート投資法人	589	85,228,300	
スターツプロシード投資法人	212	46,237,200	
大和ハウスリート投資法人	1,859	500,256,900	



ジャパン・ホテル・リート投資法人	3,981	289,816,800	
大和証券リビング投資法人	1,674	190,501,200	
ジャパンエクセレント投資法人	1,072	141,504,000	
投資証券 小計		13,183,983,800	
合計		13,183,983,800	

## 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9月12日現在)	(2023年9月11日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
預金	141,283,164	836,911,495
金銭信託	1,988,582	537,925
コール・ローン	55,892,399	22,772,077
投資証券	25,792,800,161	28,657,250,207
派生商品評価勘定	84,452	52,940
未収入金	1,725,836	3,187,911
未収配当金	46,375,941	57,921,581
流動資産合計	26,040,150,535	29,578,634,136
資産合計	26,040,150,535	29,578,634,136
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
派生商品評価勘定	343,991	148,153
未払金	7,135,212	-
未払解約金	20,688,744	14,568,268
その他未払費用	335	686
流動負債合計	28,168,282	14,717,107
負債合計	28,168,282	14,717,107
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	8,375,587,967	9,979,027,630
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	17,636,394,286	19,584,889,399
元本等合計	26,011,982,253	29,563,917,029
純資産合計	26,011,982,253	29,563,917,029
負債純資産合計	26,040,150,535	29,578,634,136

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年9月13日 至 2023年9月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。

	<p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 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9月12日現在）	（2023年9月11日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	8,375,587,967口	9,979,027,630口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.1057円 （1万口当たりの純資産額31,057円）	1口当たり純資産額 2.9626円 （1万口当たりの純資産額29,626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9月13日 至 2023年9月11日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p>

	<p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</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9月11日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券(投資証券)</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引)</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

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9月12日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	50,900,000	-	50,566,235	333,765
	オーストラリア・ドル	2,000,000	-	2,007,723	7,723
	シンガポール・ドル	1,200,000	-	1,193,095	6,905
	イギリス・ポンド	2,100,000	-	2,096,944	3,056
	小計	56,200,000	-	55,863,997	336,003
	売建				
	アメリカ・ドル	11,500,000	-	11,423,536	76,464
	小計	11,500,000	-	11,423,536	76,464
合計		67,700,000	-	67,287,533	259,539

(2023年9月11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	24,700,000	-	24,554,557	145,443
	小計	24,700,000	-	24,554,557	145,443
	売建				
	アメリカ・ドル	11,000,000	-	11,002,710	2,710
	オーストラリア・ドル	20,100,000	-	20,047,060	52,940
	小計	31,100,000	-	31,049,770	50,230
合計		55,800,000	-	55,604,327	95,213

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

#### ( 関連当事者との取引に関する注記 )

自 2022年9月13日 至 2023年9月11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9月12日現在 )	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	5,775,124,200円
同期中における追加設定元本額	3,433,415,780円
同期中における一部解約元本額	832,952,013円
2022年9月12日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	13,654,762円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	14,980,843円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	10,475,502円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	7,137,094,577円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	5,263,802円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	51,759,489円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	38,646,421円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	134,204,157円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	75,760,513円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	59,288,519円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	79,095,393円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	735,756円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド	202,203,903円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	73,572,988円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	313,985,162円
三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド	22,192,438円
S M A M・世界リート・インデックスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	37,778,851円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	30,874,063円

SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%)	
<適格機関投資家限定>	74,020,828円
合計	8,375,587,967円

(2023年9月11日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	8,375,587,967円
同期中における追加設定元本額	2,826,749,138円
同期中における一部解約元本額	1,223,309,475円
2023年9月11日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	13,398,410円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	19,774,737円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	57,234,466円
イオン・バランス戦略ファンド	40,172,185円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	8,031,891,206円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	8,150,712円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	34,590,661円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	35,439,615円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	145,174,840円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	90,253,464円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	66,931,443円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	111,536,949円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,051,013円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド	348,394,851円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	89,672,010円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	622,235,622円
三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド	113,400,205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)	30,436円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	350,802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)	1,627,905円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	790,005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)	505,663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WRリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	40,920,094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>	71,412,229円
合計	9,979,027,630円

## ( 3 ) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	14,653.00	222,139.48	
		AGREE REALTY CORP	15,181.00	916,325.16	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	12,195.00	207,680.85	
		ALEXANDER'S INC	300.00	59,184.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	24,599.00	2,829,130.99	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	2,165.00	36,869.95	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	7,000.00	143,360.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	48,526.00	1,746,936.00	
		AMERICOLD REALTY TRUST INC	41,510.00	1,364,433.70	
		APARTMENT INCOME REIT CO	23,374.00	758,018.82	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	23,200.00	172,144.00	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	32,409.00	523,405.35	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	8,429.00	94,489.09	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	2,515.00	7,695.90	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	22,330.00	4,003,322.40	
		BLUEROCK HOMES TRUST INC	468.00	6,846.84	
		BOSTON PROPERTIES INC	22,712.00	1,512,164.96	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	8,400.00	22,092.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	34,607.00	171,650.72	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	45,489.00	1,002,577.56	
		BROADSTONE NET LEASE INC	31,774.00	524,588.74	
		BRT APARTMENTS CORP	500.00	9,085.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	16,297.00	1,678,428.03	
		CARETRUST REIT INC	16,295.00	326,877.70	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	3,648.00	78,541.44	
		CENTERSPACE	2,600.00	161,408.00	
		CHATHAM LODGING TRUST	5,557.00	54,680.88	
		CITY OFFICE REIT INC	4,603.00	23,889.57	
		CLIPPER REALTY INC	800.00	4,752.00	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3,216.00	104,327.04	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	16,866.00	428,227.74	
		COUSINS PROPERTIES INC	22,991.00	531,092.10	
		CTO REALTY GROWTH INC	3,839.00	66,222.75	
CUBESMART	34,460.00	1,395,285.40			
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	33,165.00	269,299.80			
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	69,000.00	40,020.00			
DIGITAL REALTY TRUST INC	45,668.00	5,935,926.64			
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	23,884.00	54,933.20			

DOUGLAS EMMETT INC	26,346.00	361,994.04	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	20,000.00	2,740.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	15,924.00	205,419.60	
EASTGROUP PROPERTIES INC	7,157.00	1,276,522.52	
ELME COMMUNITIES	15,190.00	226,179.10	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	21,276.00	187,654.32	
EPR PROPERTIES	11,259.00	497,872.98	
EQUINIX INC	14,571.00	11,240,652.24	
EQUITY COMMONWEALTH	17,598.00	336,121.80	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	27,136.00	1,768,181.76	
EQUITY RESIDENTIAL	53,125.00	3,328,281.25	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	22,290.00	530,056.20	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,055.00	2,265,290.95	
EXTRA SPACE STORAGE INC	33,051.00	4,177,315.89	
FARMLAND PARTNERS INC	7,194.00	76,975.80	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	11,091.00	1,082,592.51	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	20,455.00	1,036,863.95	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	13,780.00	339,677.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	15,115.00	28,567.35	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	40,380.00	1,980,235.20	
GETTY REALTY CORP	6,971.00	209,339.13	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5,368.00	71,287.04	
GLADSTONE LAND CORP	4,464.00	67,406.40	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	12,642.00	119,214.06	
GLOBAL NET LEASE INC	19,113.00	215,403.51	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	59,433.00	993,719.76	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	85,738.00	1,716,474.76	
HERSHA HOSPITALITY TRUST-A	4,276.00	42,075.84	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	16,359.00	388,853.43	
HOST HOTELS & RESORTS INC	111,435.00	1,788,531.75	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	17,289.00	124,653.69	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	36,893.00	592,501.58	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	6,274.00	23,025.58	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	4,322.00	382,929.20	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	11,866.00	289,886.38	
INVITATION HOMES INC	91,527.00	3,100,934.76	
IRON MOUNTAIN INC	45,585.00	2,857,267.80	
JBG SMITH PROPERTIES	14,792.00	231,494.80	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	130,900.00	30,107.00	
KILROY REALTY CORP	16,719.00	626,293.74	
KIMCO REALTY CORP	96,981.00	1,801,906.98	
KITE REALTY GROUP TRUST	34,000.00	769,760.00	
LTC PROPERTIES INC	7,251.00	231,886.98	
LXP INDUSTRIAL TRUST	43,773.00	421,096.26	



MACERICH CO/THE	32,750.00	384,812.50	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	245,900.00	13,770.40	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	97,588.00	647,984.32	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	18,198.00	2,509,504.20	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	13,122.00	445,754.34	
NATL HEALTH INVESTORS INC	6,051.00	305,817.54	
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	17,023.00	128,183.19	
NETSTREIT CORP	8,448.00	143,109.12	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	7,478.00	68,648.04	
NEXPOINT RESIDENTIAL	3,529.00	127,749.80	
NNN REIT INC	28,055.00	1,067,492.75	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	9,538.00	56,178.82	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	36,338.00	1,166,813.18	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,352.00	45,628.80	
ORION OFFICE REIT INC	8,094.00	44,436.06	
PARAMOUNT GROUP INC	23,577.00	120,714.24	
PARK HOTELS & RESORTS INC	35,722.00	460,813.80	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	20,329.00	301,885.65	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	17,364.00	610,344.60	
PHYSICIANS REALTY TRUST	36,597.00	489,301.89	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	19,902.00	135,134.58	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,774.00	108,560.76	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	1,424.00	20,235.04	
PRIME US REIT	130,700.00	17,383.10	
PROLOGIS INC	144,248.00	17,667,495.04	
PUBLIC STORAGE	24,736.00	6,769,253.76	
REALTY INCOME CORP	105,073.00	5,812,638.36	
REGENCY CENTERS CORP	26,538.00	1,700,289.66	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	22,092.00	297,358.32	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	31,364.00	1,667,623.88	
RLJ LODGING TRUST	24,132.00	243,733.20	
RPT REALTY	11,788.00	132,732.88	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	9,114.00	794,558.52	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	32,679.00	428,421.69	
SAFEHOLD INC	5,574.00	109,752.06	
SAUL CENTERS INC	2,331.00	87,459.12	
SERVICE PROPERTIES TRUST	25,446.00	199,496.64	
SIMON PROPERTY GROUP INC	51,267.00	5,876,223.54	
SITE CENTERS CORP	26,013.00	355,597.71	
SL GREEN REALTY CORP	9,537.00	385,294.80	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	22,155.00	820,842.75	
STAG INDUSTRIAL INC	27,802.00	1,016,997.16	
STAR HOLDINGS	2,111.00	26,957.47	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	14,098.00	83,037.22	

	SUN COMMUNITIES INC	19,281.00	2,291,161.23	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	32,379.00	292,382.37	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	15,336.00	358,402.32	
	TERRENO REALTY CORP	11,336.00	689,455.52	
	UDR INC	48,632.00	1,880,113.12	
	UMH PROPERTIES INC	11,316.00	166,571.52	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,344.00	60,359.04	
	URBAN EDGE PROPERTIES	20,402.00	336,020.94	
	VENTAS INC	62,544.00	2,650,614.72	
	VERIS RESIDENTIAL INC	10,798.00	193,932.08	
	VICI PROPERTIES INC	157,420.00	4,909,929.80	
	VORNADO REALTY TRUST	24,385.00	614,258.15	
	WELLTOWER INC	77,803.00	6,426,527.80	
	WHITESTONE REIT	4,511.00	44,523.57	
	WP CAREY INC	33,806.00	2,157,498.92	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	17,827.00	213,924.00	
	アメリカ・ドル小計	4,004,260.00	152,714,994.29 (22,444,522,711)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	8,800.00	179,432.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	9,662.00	65,315.12	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	4,023.00	41,839.20	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,190.00	222,343.00	
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	3,187.00	52,298.67	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	6,841.00	21,788.58	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	12,440.00	610,057.60	
	CHOICE PROPERTIES REIT	23,858.00	310,631.16	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	10,639.00	142,775.38	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	9,193.00	132,838.85	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	23,474.00	320,420.10	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,465.00	64,159.10	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	11,377.00	27,759.88	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	14,775.00	204,781.50	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	5,260.00	395,394.20	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	21,001.00	216,730.32	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	1,387.00	4,521.62	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11,198.00	141,318.76	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	8,107.00	147,952.75	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,447.00	18,912.29	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1,557.00	24,164.64	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	4,345.00	33,586.85	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	20,754.00	139,674.42	
	PRIMARIS REIT	6,318.00	85,419.36	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	21,805.00	417,129.65		
SLATE GROCERY REIT-CL U	3,196.00	40,685.08		

	SLATE OFFICE REIT	3,663.00	5,750.91	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	12,000.00	286,800.00	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4,770.00	11,257.20	
	カナダ・ドル小計	273,732.00	4,365,738.19 (470,801,206)	
オーストラ リア・ドル	ABACUS GROUP	50,980.00	56,587.80	
	ABACUS STORAGE KING	50,980.00	61,430.90	
	ARENA REIT	45,981.00	167,370.84	
	BWP TRUST	66,965.00	245,761.55	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	104,758.00	152,422.89	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	84,443.00	257,551.15	
	CENTURIA OFFICE REIT	68,559.00	84,670.36	
	CHARTER HALL GROUP	73,143.00	750,447.18	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	97,225.00	343,204.25	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	91,686.00	311,732.40	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	72,491.00	200,075.16	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	218,718.00	95,142.33	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	30,237.00	84,361.23	
	DEXUS/AU	168,087.00	1,269,056.85	
	GDI PROPERTY GROUP	83,204.00	52,418.52	
	GOODMAN GROUP	265,983.00	6,168,145.77	
	GPT GROUP	305,971.00	1,269,779.65	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	52,361.00	124,095.57	
	HEALTHCO REIT	51,410.00	76,600.90	
	HMC CAPITAL LTD	33,678.00	180,850.86	
	HOMEKO DAILY NEEDS REIT	239,155.00	288,181.77	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	25,921.00	78,540.63	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	62,840.00	257,644.00	
	MIRVAC GROUP	634,643.00	1,491,411.05	
	NATIONAL STORAGE REIT	208,817.00	465,661.91	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	89,106.00	65,492.91	
	REGION RE LTD	191,819.00	402,819.90	
	RURAL FUNDS GROUP	52,739.00	107,060.17	
SCENTRE GROUP	801,211.00	2,131,221.26		
STOCKLAND	370,014.00	1,487,456.28		
VICINITY CENTRES	591,192.00	1,075,969.44		
WAYPOINT REIT	113,111.00	277,121.95		
	オーストラリア・ドル小計	5,397,428.00	20,080,287.43 (1,887,547,018)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	277,000.00	720,200.00	
	FORTUNE REIT	259,000.00	1,258,740.00	
	LINK REIT	403,700.00	15,562,635.00	
	PROSPERITY REIT	178,000.00	265,220.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	110,000.00	300,300.00	

	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	293,000.00	427,780.00	
	香港・ドル小計	1,520,700.00	18,534,875.00 (347,343,558)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT	113,300.00	143,891.00	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	515,700.00	1,433,646.00	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	318,755.00	317,161.22	
	CAPITALAND CHINA TRUST	205,700.00	186,158.50	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	778,808.00	1,471,947.12	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	159,550.00	167,527.50	
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	44,500.00	25,142.50	
	EC WORLD REIT	52,800.00	14,784.00	
	ESR-LOGOS REIT	1,097,413.00	351,172.16	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	190,000.00	120,650.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	176,400.00	43,218.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	166,800.00	375,300.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC I	433,738.00	511,810.84	
	KEPPEL DC REIT	200,100.00	436,218.00	
	KEPPEL REIT	275,800.00	242,704.00	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	262,000.00	142,790.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	324,500.00	752,840.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	495,150.00	826,900.50	
	MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	355,000.00	525,400.00	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	502,900.00	113,152.50	
PARAGON REIT	215,200.00	192,604.00		
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	69,800.00	264,542.00		
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	66,700.00	45,022.50		
STARHILL GLOBAL REIT	195,000.00	95,550.00		
SUNTEC REIT	324,800.00	396,256.00		
	シンガポール・ドル小計	7,540,414.00	9,196,388.34 (991,094,771)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	153,482.00	173,434.66	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	163,249.00	352,617.84	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	200,506.00	170,430.10	
	PRECINCT PROPERTIES GROUP	217,149.00	252,978.58	
	STRIDE PROPERTY GROUP	90,554.00	124,058.98	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	77,686.00	163,529.03	
	ニュージーランド・ドル小計	902,626.00	1,237,049.19 (107,375,870)	
イギリス・ポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	53,280.00	25,574.40	
	AEW UK REIT PLC	9,000.00	8,901.00	
	ASSURA PLC	472,915.00	210,920.09	
	BALANCED COMM PROPERTY TRUST	154,750.00	109,563.00	
	BIG YELLOW GROUP PLC	26,200.00	268,288.00	
	BRITISH LAND CO PLC	150,571.00	468,426.38	

	CLS HOLDINGS PLC	41,598.00	52,663.06	
	CUSTODIAN PROPERTY INCOME RE	84,958.00	69,410.68	
	DERWENT LONDON PLC	17,263.00	317,811.83	
	EDISTON PROPERTY INVESTMENT	48,662.00	34,063.40	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	95,000.00	84,360.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	41,616.00	173,289.02	
	HAMMERSON PLC	591,835.00	147,366.91	
	HELICAL PLC	17,000.00	37,825.00	
	HOME REIT PLC	96,051.00	36,499.38	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	88,651.00	78,988.04	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	116,859.00	674,743.86	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	170,834.00	295,884.48	
	LXI REIT PLC	247,814.00	227,493.25	
	NEWRIVER REIT PLC	46,021.00	37,323.03	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	57,141.00	38,455.89	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	212,067.00	196,586.10	
	PRS REIT PLC/THE	89,207.00	62,890.93	
	REGIONAL REIT LTD	45,664.00	20,366.14	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	31,848.00	256,535.64	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	70,698.00	28,915.48	
	SEGRO PLC	190,440.00	1,383,356.16	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	304,853.00	358,811.98	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	187,422.00	142,253.29	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	34,770.00	20,166.60	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	288,959.00	399,341.33	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	117,847.00	63,637.38	
	UNITE GROUP PLC/THE	62,834.00	578,386.97	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	76,400.00	86,484.80	
	WAREHOUSE REIT PLC	72,100.00	58,617.30	
	WORKSPACE GROUP PLC	20,210.00	98,301.44	
	イギリス・ボンド小計	4,433,338.00	7,152,502.24 (1,312,770,261)	
イスラエル・シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	110,000.00	166,870.00	
	REIT 1 LTD	29,102.00	451,081.00	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	36,242.00	275,257.99	
	イスラエル・シュケル小計	175,344.00	893,208.99 (34,072,707)	
韓国・ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	6,350.00	19,621,500.00	
	E KOCREF CR-REIT CO LTD	8,422.00	42,446,880.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	24,000.00	95,160,000.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	4,067.00	17,711,785.00	
	JR REIT XXVII	19,000.00	77,140,000.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	6,226.00	34,865,600.00	
	LOTTE REIT CO LTD	20,121.00	69,417,450.00	

	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	17,727.00	72,326,160.00	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	12,561.00	40,948,860.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	8,762.00	54,762,500.00	
	SK REITS CO LTD	12,831.00	56,135,625.00	
	SK REITS CO LTD-RIGHTS	4,803.00	33,621.00	
	韓国・ウォン小計	144,870.00	580,569,981.00 (63,978,812)	
ユーロ	AEDIFICA	7,278.00	431,221.50	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	1,380.00	6,244.50	
	ALTAREA	723.00	66,371.40	
	CARE PROPERTY INVEST	5,582.00	70,779.76	
	CARMILA	10,208.00	147,607.68	
	COFINIMMO	4,682.00	331,251.50	
	COVIVIO	7,454.00	330,957.60	
	CROMWELL REIT EUR	48,320.00	69,580.80	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	6,975.00	150,799.50	
	GECINA SA	8,692.00	850,077.60	
	HAMBORNER REIT AG	10,700.00	69,657.00	
	ICADE	4,873.00	164,512.48	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	7,889.00	17,750.25	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	44,900.00	249,419.50	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	4,899.00	71,721.36	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	62,588.00	61,023.30	
	KLEPIERRE	29,963.00	728,700.16	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	6,940.00	39,974.40	
	MERCIALYS	11,000.00	96,800.00	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	52,906.00	429,332.19	
	MONTEA NV	1,880.00	135,172.00	
	NSI NV	2,966.00	55,286.24	
	RETAIL ESTATES	2,065.00	117,498.50	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	16,472.00	793,950.40	
	VASTNED RETAIL NV	2,919.00	57,037.26	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	24,334.00	610,296.72	
	WERELDHAVE NV	5,522.00	86,087.98	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	3,590.00	96,571.00	
	ユーロ小計	397,700.00	6,335,682.58 (997,743,293)	
	投資証券合計		28,657,250,207 (28,657,250,207)	
	合計		28,657,250,207 (28,657,250,207)	

(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
	投資証券	銘柄数		
アメリカ・ドル	投資証券	142銘柄	75.9%	78.3%
カナダ・ドル	投資証券	29銘柄	1.6%	1.6%
オーストラリア・ドル	投資証券	32銘柄	6.4%	6.6%
香港・ドル	投資証券	6銘柄	1.2%	1.2%
シンガポール・ドル	投資証券	25銘柄	3.4%	3.5%
ニュージーランド・ドル	投資証券	6銘柄	0.4%	0.4%
イギリス・ポンド	投資証券	36銘柄	4.4%	4.6%
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	12銘柄	0.2%	0.2%
ユーロ	投資証券	28銘柄	3.4%	3.5%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

**【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7期中間計算期間(2023年9月12日から2024年3月11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。



## 【三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第6期 (2023年 9月11日現在)	第7期中間計算期間 (2024年 3月11日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	636,228	748,247
コール・ローン	26,933,570	30,214,956
親投資信託受益証券	2,194,933,022	2,610,381,143
未収入金	3,200,000	2,050,000
流動資産合計	2,225,702,820	2,643,394,346
資産合計	2,225,702,820	2,643,394,346
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	5,928,762	3,462,203
未払受託者報酬	224,291	261,890
未払委託者報酬	2,131,087	2,488,365
その他未払費用	67,424	78,583
流動負債合計	8,351,564	6,291,041
負債合計	8,351,564	6,291,041
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,577,588,079	1,754,053,370
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	639,763,177	883,049,935
（分配準備積立金）	292,408,266	276,180,215
元本等合計	2,217,351,256	2,637,103,305
純資産合計	2,217,351,256	2,637,103,305
負債純資産合計	2,225,702,820	2,643,394,346

## （ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第6期中間計算期間 自 2022年 9月13日 至 2023年 3月12日	第7期中間計算期間 自 2023年 9月12日 至 2024年 3月11日
<b>営業収益</b>		
受取利息	77	91
有価証券売買等損益	74,992,426	169,076,121
<b>営業収益合計</b>	<b>74,992,349</b>	<b>169,076,212</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	4,747	3,363
受託者報酬	184,532	261,890
委託者報酬	1,753,473	2,488,365
その他費用	55,652	78,808
<b>営業費用合計</b>	<b>1,998,404</b>	<b>2,832,426</b>
<b>営業利益又は営業損失（ ）</b>	<b>76,990,753</b>	<b>166,243,786</b>
経常利益又は経常損失（ ）	76,990,753	166,243,786
<b>中間純利益又は中間純損失（ ）</b>	<b>76,990,753</b>	<b>166,243,786</b>
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	2,925,253	3,484,966
<b>期首剰余金又は期首欠損金（ ）</b>	<b>420,227,437</b>	<b>639,763,177</b>
剰余金増加額又は欠損金減少額	73,151,554	119,408,021
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	73,151,554	119,408,021
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>18,705,953</b>	<b>38,880,083</b>
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	18,705,953	38,880,083
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
<b>中間剰余金又は中間欠損金（ ）</b>	<b>400,607,538</b>	<b>883,049,935</b>

## (3) 【中間注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第7期中間計算期間 自 2023年9月12日 至 2024年3月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. その他中間財務諸表作成のための重要な事項	<p>中間計算期間の取扱い</p> <p>当中間計算期間は前期末が休日のため、2023年9月12日から2024年3月11日までとなっております。</p>

## (中間貸借対照表に関する注記)

項目	第6期 (2023年9月11日現在)	第7期中間計算期間 (2024年3月11日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	1,577,588,079口	1,754,053,370口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.4055円 (1万口当たりの純資産額14,055円)	1口当たり純資産額 1.5034円 (1万口当たりの純資産額15,034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7期中間計算期間 (2024年3月11日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>

	(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

項目	第6期 (2023年9月11日現在)	第7期中間計算期間 (2024年3月11日現在)
期首元本額	1,214,217,954円	1,577,588,079円
期中追加設定元本額	492,057,391円	272,113,185円
期中一部解約元本額	128,687,266円	95,647,894円

## (参考)

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

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2023年9月11日現在)	(2024年3月11日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	10,210,097	10,401,110
コール・ローン	432,225,963	420,006,870
国債証券	101,717,238,760	105,777,217,850
地方債証券	9,945,071,700	8,605,753,000
特殊債券	9,472,283,708	10,440,722,518
社債券	6,161,963,800	7,063,512,400
未収利息	345,064,327	367,408,891
前払費用	22,954,890	19,966,870
流動資産合計	128,107,013,245	132,704,989,509
資産合計	128,107,013,245	132,704,989,509
負債の部		
流動負債		
未払金	94,901,000	37,545,200

未払解約金	160,000	19,057,843
その他未払費用	5,714	1,265
流動負債合計	95,066,714	56,604,308
負債合計	95,066,714	56,604,308
純資産の部		
元本等		
元本	105,595,755,237	109,604,685,583
剰余金		
剰余金又は欠損金 ( )	22,416,191,294	23,043,699,618
元本等合計	128,011,946,531	132,648,385,201
純資産合計	128,011,946,531	132,648,385,201
負債純資産合計	128,107,013,245	132,704,989,509

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項 目	自 2023年9月12日 至 2024年3月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項 目	(2023年9月11日現在)	(2024年3月11日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	105,595,755,237口	109,604,685,583口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2123円 (1万口当たりの純資産額12,123円)	1口当たり純資産額 1.2102円 (1万口当たりの純資産額12,102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	(2024年3月11日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。

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

## (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9月11日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	105,070,373,916円
同期中における追加設定元本額	29,627,474,001円
同期中における一部解約元本額	29,102,092,680円
2023年9月11日現在の元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	8,895,871,906円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	14,276,531,560円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,639,693,680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)	871,073,171円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	41,964,940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)	189,022,302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)	597,899,046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)	1,152,268,985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)	635,710,120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)	765,396,816円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	145,241,149円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	943,791,009円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	331,990,644円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	13,054,188円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	86,411,203円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	4,478,509,550円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,439,958,484円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	2,358,439,215円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	554,742,232円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	53,974,627円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	269,611,226円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	370,316,428円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	769,947,923円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	239,821,733円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	11,065,309円

三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2035	395,316円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2040	340,706円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2045	234,563円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2055	113,477円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2065	115,120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)	2,360,942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)	12,350,202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)	31,875,293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)	7,622,799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)	992,596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>	1,091,741,014円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	9,468,188,150円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	5,717,595,087円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	14,505,099,336円
S M A M ・ バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	299,776,143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>	486,840,988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>	264,798,022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>	116,608,704円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 2 5 <適格機関投資家専用>	1,721,293,475円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 5 0 <適格機関投資家専用>	2,097,868,199円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用>	2,141,404,899円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 <適格機関投資家専用>	7,504,519,879円
S M A M ・ バランスV A 株40T<適格機関投資家限定>	1,001,996円
三井住友・国内債券インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	997,923,867円
S M A M ・ グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	378,194,192円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A <適格機関投資家専用>	466,557,662円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A <適格機関投資家専用>	171,339,049円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A <適格機関投資家専用>	47,446,788円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L <適格機関投資家専用>	1,194,682,155円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L <適格機関投資家専用>	1,995,130,514円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 <適格機関投資家専用>	588,317,252円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 <適格機関投資家専用>	208,632,864円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 <適格機関投資家専用>	21,745,950円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 0 L 2 <適格機関投資家専用>	253,927,864円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 <適格機関投資家専用>	4,607,178,796円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	1,270,648,412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>	801,786,380円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	1,280,562,535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>	2,417,659,545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>	288,577,060円
合 計	105,595,755,237円

(2024年3月11日現在)

開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額

105,595,755,237円

同期中における追加設定元本額	13,252,670,977円
同期中における一部解約元本額	9,243,740,631円
2024年3月11日現在の元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	9,727,006,230円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	15,714,274,054円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	4,104,212,009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)	939,814,174円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	43,075,854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)	194,476,250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)	634,840,626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)	1,273,682,843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)	712,443,679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)	874,776,765円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	139,450,265円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	829,342,057円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	244,972,210円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	13,534,979円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	112,071,391円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	5,054,838,592円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,735,898,110円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	2,896,848,288円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	703,806,893円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	77,062,937円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	322,789,396円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	416,100,551円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	929,601,558円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	305,698,871円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	11,558,117円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	78,267,370円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	35,174,743円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	28,265,511円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	3,491,264円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	2,083,478円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	7,860,420円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	47,096,646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)	134,264,899円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	45,311,303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)	5,268,596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>	1,035,185,575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>	8,541,341,773円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用>	5,883,555,619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>	15,391,388,506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>	306,375,000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>	497,670,273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>	274,074,334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>	118,270,332円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5<適格機関投資家専用>	1,732,178,254円



SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,201,314,761円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,138,773,236円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	7,464,236,456円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	934,803,029円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	370,979,799円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	448,136,826円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	180,473,962円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	51,549,601円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,121,752,777円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	1,953,339,453円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	569,691,182円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	220,775,391円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	25,746,829円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	247,758,985円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	4,568,171,763円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	1,212,786,710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>	772,470,672円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	1,232,425,839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>	902,525,395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>	807,672,322円
合計	109,604,685,583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9月11日現在)	(2024年3月11日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
預金	37,148,722	29,507,227
金銭信託	3,665,467	1,895,469
コール・ローン	155,170,920	76,540,853
国債証券	18,922,834,265	20,671,868,139
派生商品評価勘定	33,548,149	265,616,585
未収利息	112,115,149	143,344,134
前払費用	18,930,362	20,194,642
流動資産合計	19,283,413,034	21,208,967,049
<b>資産合計</b>		
	19,283,413,034	21,208,967,049
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
派生商品評価勘定	97,323,664	-
未払解約金	3,864,250	10,935,000
その他未払費用	1,478	563
流動負債合計	101,189,392	10,935,563
<b>負債合計</b>		
	101,189,392	10,935,563

純資産の部		
元本等		
元本	15,785,182,828	17,234,543,869
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	3,397,040,814	3,963,487,617
元本等合計	19,182,223,642	21,198,031,486
純資産合計	19,182,223,642	21,198,031,486
負債純資産合計	19,283,413,034	21,208,967,049

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年9月12日 至 2024年3月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2023年9月11日現在)	(2024年3月11日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	15,785,182,828口	17,234,543,869口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2152円 (1万口当たりの純資産額12,152円)	1口当たり純資産額 1.2300円 (1万口当たりの純資産額12,300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	(2024年3月11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	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2023年9月11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	9,145,118,008	-	9,240,925,927	95,807,919
	カナダ・ドル	382,479,901	-	383,646,480	1,166,579
	オーストラリア・ドル	282,744,725	-	282,073,120	671,605
	シンガポール・ドル	185,858,965	-	185,911,509	52,544
	ニュージーランド・ドル	43,144,661	-	43,235,150	90,489
	イギリス・ポンド	955,003,538	-	950,939,600	4,063,938
	イスラエル・シケル	57,719,381	-	57,428,622	290,759
	デンマーク・クローネ	61,506,134	-	61,302,933	203,201
	ノルウェー・クローネ	30,947,347	-	31,153,480	206,133
	スウェーデン・クローナ	36,574,925	-	36,457,668	117,257
	メキシコ・ペソ	195,309,807	-	189,380,025	5,929,782
	オフショア・人民元	1,260,443,264	-	1,259,056,848	1,386,416
	ポーランド・ズロチ	96,537,316	-	93,305,575	3,231,741
	ユーロ	6,332,967,693	-	6,315,314,243	17,653,450
	小計	19,066,355,665	-	19,130,131,180	63,775,515
合計	19,066,355,665	-	19,130,131,180	63,775,515	

(2024年3月11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	9,755,472,372	-	9,580,704,650	174,767,722
	カナダ・ドル	419,677,271	-	414,693,088	4,984,183
	オーストラリア・ド ル	283,466,504	-	283,146,852	319,652
	シンガポール・ドル	191,893,573	-	190,400,513	1,493,060
	ニュージーランド・ ドル	51,723,664	-	51,516,258	207,406
	イギリス・ポンド	1,077,912,737	-	1,076,038,964	1,873,773
	イスラエル・シユケ ル	71,791,814	-	70,247,380	1,544,434
	デンマーク・クロー ネ	55,874,888	-	55,459,164	415,724
	ノルウェー・クロー ネ	37,970,997	-	37,890,450	80,547
	スウェーデン・ク ローナ	44,535,764	-	44,345,517	190,247
	メキシコ・ペソ	188,511,174	-	188,310,369	200,805
	オフショア・人民元	1,837,340,954	-	1,806,158,805	31,182,149
	ポーランド・ズロチ	115,356,843	-	114,892,071	464,772
	ユーロ	6,687,541,519	-	6,639,649,408	47,892,111
	小計	20,819,070,074	-	20,553,453,489	265,616,585
	合 計	20,819,070,074	-	20,553,453,489	265,616,585

## （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9月11日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	20,045,986,946円
同期中における追加設定元本額	10,298,549,113円
同期中における一部解約元本額	14,559,353,231円
2023年9月11日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	1,757,814,559円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	592,185,183円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	11,933,989円
イオン・バランス戦略ファンド	864,182,580円
三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）	1,350,410,842円
三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）	586,893,997円
三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）	1,173,539,486円
三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）	332,985,607円
三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）	52,630,230円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	85,609,309円
日興FWS・先進国債インデックス（為替ヘッジあり）	613,150,901円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）	2,955,830円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）	15,393,411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）	39,736,679円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）	9,542,434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）	1,224,416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＞	1,089,575,826円
S M A M・バランスV A株40T＜適格機関投資家限定＞	1,006,607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＞	5,526,794,175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＞	608,135,876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＞	382,886,890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＞	612,248,747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＞	74,345,254円
合計	15,785,182,828円

（2024年3月11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	15,785,182,828円
同期中における追加設定元本額	6,776,886,413円
同期中における一部解約元本額	5,327,525,372円
2024年3月11日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	1,770,803,232円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	599,388,293円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	9,479,909円
イオン・バランス戦略ファンド	726,353,698円

三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	1,522,547,593円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	707,294,808円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	1,437,311,160円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	418,450,282円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	72,324,019円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	103,090,298円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)	381,453,256円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	7,293,919円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	46,954,415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)	133,785,249円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	45,152,872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)	4,638,930円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,026,175,405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>	5,982,912,916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>	682,283,481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>	444,023,155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>	709,048,602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>	403,778,377円
合計	17,234,543,869円

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2023年9月11日現在)	(2024年3月11日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
預金	217,197,619	215,214,954
金銭信託	21,927,226	30,410,504
コール・ローン	928,249,419	1,228,005,514
国債証券	165,129,161,640	177,278,336,372
未収利息	1,038,102,290	1,278,459,728
前払費用	88,967,311	117,289,549
流動資産合計	167,423,605,505	180,147,716,621
資産合計		
	167,423,605,505	180,147,716,621
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	12,794,196	54,539,324
その他未払費用	7,990	3,643
流動負債合計	12,802,186	54,542,967
負債合計		
	12,802,186	54,542,967
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	79,394,261,585	81,180,123,823
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	88,016,541,734	98,913,049,831

元本等合計	167,410,803,319	180,093,173,654
純資産合計	167,410,803,319	180,093,173,654
負債純資産合計	167,423,605,505	180,147,716,621

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年9月12日 至 2024年3月11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9月11日現在)	(2024年3月11日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	79,394,261,585口	81,180,123,823口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.1086円 (1万口当たりの純資産額21,086円)	1口当たり純資産額 2.2184円 (1万口当たりの純資産額22,184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	(2024年3月11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>

	(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9月11日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	76,795,410,154円
同期中における追加設定元本額	13,399,654,234円
同期中における一部解約元本額	10,800,802,803円
2023年9月11日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	26,603,451,045円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	930,561,373円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,323,254,511円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,415,352,860円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	164,009,819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)	5,977,634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)	25,661,980円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	96,927,254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)	286,725,074円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	210,028,401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)	340,690,759円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	22,249,143円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	166,128,425円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	180,392,210円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	100,600,584円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	34,074,328円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	339,520,384円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	217,974,152円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	605,311,705円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	191,603,396円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	93,190,694円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	208,489,850円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	894,110,043円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	38,751,866円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	126,408,326円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	90,751,827円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	4,358,624円
日興F W S・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	1,219,374,866円



三井住友D S ・先進国債インデックス・ファンド	234,491,533円
三井住友D S ・D Cターゲットイヤーファンド2 0 3 5	26,867円
三井住友D S ・D Cターゲットイヤーファンド2 0 4 0	31,324円
三井住友D S ・D Cターゲットイヤーファンド2 0 4 5	39,141円
三井住友D S ・D Cターゲットイヤーファンド2 0 5 5	47,947円
三井住友D S ・D Cターゲットイヤーファンド2 0 6 5	47,947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)	475,572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)	4,199,196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)	17,467,272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)	7,928,172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)	4,481,444円
S M A M ・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	4,735,092,348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>	24,742,199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>	4,765,081,202円
S M A M ・バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	3,776,414,227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>	8,946,687,136円
S M A M ・バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	29,825,111円
S M A M ・バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定>	70,919,769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>	650,211,181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>	105,409,785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>	891,341,019円
S M A M ・インデックス・バランスV A 5 0 <適格機関投資家専用>	1,260,343,854円
S M A M ・バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用>	1,251,043,047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>	3,841,934,104円
S M A M ・バランスV A 株4 0 T <適格機関投資家限定>	604,716円
S M A M ・外国債券パッシブファンドV A <適格機関投資家限定>	6,597,388,341円
三井住友・外国債券インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	317,910,827円
S M A M ・グローバルバランス4 0 V A <適格機関投資家限定>	110,161,119円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 0 A <適格機関投資家専用>	61,534,170円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 3 5 A <適格機関投資家専用>	29,749,375円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 5 0 A <適格機関投資家専用>	11,741,981円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 0 L <適格機関投資家専用>	70,316,869円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 5 L <適格機関投資家専用>	350,309,527円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 <適格機関投資家専用>	76,242,287円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 <適格機関投資家専用>	37,643,421円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 <適格機関投資家専用>	5,511,845円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 <適格機関投資家専用>	820,004,466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>	489,884,162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>	668,807,457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>	284,791,331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>	229,812,549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>	119,206,614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>	57,520,352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>	91,943,891円
S M A M ・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド <適格機関投資家限定>	1,335,263,034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 >	73,700,721円
合計	79,394,261,585円

(2024年3月11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	79,394,261,585円
同期中における追加設定元本額	7,523,324,254円
同期中における一部解約元本額	5,737,462,016円
2024年3月11日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	27,372,480,390円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	969,291,403円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,437,524,335円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,482,471,479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)	165,914,478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)	5,712,728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)	24,969,215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)	95,498,475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)	293,433,368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)	222,554,062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)	364,364,727円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	20,176,872円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	57,265,000円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	101,159,985円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	64,458,044円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2050	41,995,882円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	359,406,170円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	247,327,453円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	703,418,055円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	227,172,109円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	120,184,802円
三井住友・DCつみたてN I S A ・ 世界分散ファンド	233,712,661円
三井住友D S ・ 外国債券インデックス年金ファンド	1,088,148,022円
三井住友D S ・ 年金バランス30(債券重点型)	41,184,328円
三井住友D S ・ 年金バランス50(標準型)	143,868,381円
三井住友D S ・ 年金バランス70(株式重点型)	110,848,238円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2060	4,300,688円
日興F W S ・ 先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	3,448,991,887円
三井住友D S ・ 先進国債インデックス・ファンド	308,383,784円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2035	4,761,120円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2040	2,984,752円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2045	4,237,118円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2055	1,286,550円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2065	771,479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)	751,785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)	8,666,727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)	35,438,527円

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	19,405,993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)	6,715,230円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	5,105,079,793円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	21,269,064円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	4,041,298,650円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	3,597,206,169円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	8,585,342,356円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	28,565,773円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	68,538,172円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	646,535,008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>	97,653,517円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	843,878,697円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,219,045,963円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,182,676,466円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	3,585,194,533円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	6,191,016,644円
三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	291,026,315円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	101,932,994円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	55,570,310円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	29,310,007円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,741,981円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	63,446,869円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	324,638,043円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	69,815,523円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	37,190,973円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,805,044円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	776,247,405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>	475,694,440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>	617,018,437円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	247,141,919円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	211,356,046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>	139,618,688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>	73,927,877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>	118,450,386円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	1,151,299,991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>	324,353,468円
合計	81,180,123,823円

## 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

## (1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2023年9月11日現在)	(2024年3月11日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	49,747,753	47,692,400

コール・ローン	2,105,981,016	1,925,865,148
株式	276,740,872,060	319,115,512,940
未収配当金	133,452,128	483,490,803
前払金	4,675,000	-
差入委託証拠金	79,050,000	89,817,125
流動資産合計	279,113,777,957	321,662,378,416
資産合計	279,113,777,957	321,662,378,416
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,218,500	37,255,800
前受金	-	10,800,000
未払解約金	294,798,093	368,514,967
その他未払費用	33,303	11,756
流動負債合計	297,049,896	416,582,523
負債合計	297,049,896	416,582,523
純資産の部		
元本等		
元本	67,733,425,616	68,297,511,279
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	211,083,302,445	252,948,284,614
元本等合計	278,816,728,061	321,245,795,893
純資産合計	278,816,728,061	321,245,795,893
負債純資産合計	279,113,777,957	321,662,378,416

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年9月12日 至 2024年3月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（2023年9月11日現在）	（2024年3月11日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	67,733,425,616口	68,297,511,279口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 4.1164円 （1万口当たりの純資産額41,164円）	1口当たり純資産額 4.7036円 （1万口当たりの純資産額47,036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	（2024年3月11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9月11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	1,994,193,500	-	1,991,975,000	2,218,500
	小計	1,994,193,500	-	1,991,975,000	2,218,500
合計		1,994,193,500	-	1,991,975,000	2,218,500

（2024年3月11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				

市場取引	TOPIX 先物 0606月	2,098,405,800	-	2,061,150,000	37,255,800
	小計	2,098,405,800	-	2,061,150,000	37,255,800
	合計	2,098,405,800	-	2,061,150,000	37,255,800

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (その他の注記)

(2023年9月11日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	64,681,311,514円
同期中における追加設定元本額	11,902,850,475円
同期中における一部解約元本額	8,850,736,373円
2023年9月11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	9,591,481,988円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	1,007,680,143円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,516,293,931円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,642,841,830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)	162,411,744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)	3,566,971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)	15,726,214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)	56,375,030円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	157,876,103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)	147,286,974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)	270,312,573円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,281,339,864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	25,135,439,200円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	263,303,999円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	336,243,520円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	202,765,236円
イオン・バランス戦略ファンド	87,515,647円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	49,107,745円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	203,601,343円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	191,016,426円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	744,856,646円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	426,486,522円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	496,767,890円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	54,438,122円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	1,079,692,316円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	39,416,892円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	231,146,504円

三井住友D S ・年金バランス70(株式重点型)	239,344,365円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2060	6,297,797円
日興FWS ・日本株インデックス	1,894,762,882円
三井住友D S ・TOPIXインデックス・ファンド	48,035,769円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2035	43,516円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2040	51,540円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2045	61,241円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2055	74,595円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2065	74,595円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	350,209円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	3,814,930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)	17,184,361円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	8,499,319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)	5,286,087円
SMAM ・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,483,964,175円
バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	8,759,088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 >	1,039,591,664円
SMAM ・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	1,218,612,918円
SMAM ・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	4,693,186,871円
SMAM ・バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 >	31,653,541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 >	608,209,715円
SMAM ・バランスファンドVL国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	36,747,614円
SMAM ・インデックス・バランスVA25 < 適格機関投資家専用 >	201,101,365円
SMAM ・インデックス・バランスVA50 < 適格機関投資家専用 >	670,613,844円
SMAM ・バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 >	432,830,639円
SMAM ・バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 >	1,339,067,175円
SMAM ・バランスVA株40T < 適格機関投資家限定 >	322,605円
SMAM ・グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	29,607,883円
SMAM ・アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 >	31,750,643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 >	72,250,966円
SMAM ・アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 >	183,363,073円
SMAM ・アセットバランスファンドVA20A2 < 適格機関投資家専用 >	39,684,868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 >	32,686,441円
SMAM ・アセットバランスファンドVA25L2 < 適格機関投資家専用 >	427,173,399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)	153,857,659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 >	70,095,844円
SMAM ・世界バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 >	57,894,803円
SMAM ・世界バランスファンドVA2 < 適格機関投資家限定 >	32,775,213円
SMAM ・年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	57,132,194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 >	32,927,167円

S M A M・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	52,627,461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>	621,240,315円
S M D A M・日米3資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	18,098,332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>	32,461,404円
合 計	67,733,425,616円

(2024年3月11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	67,733,425,616円
同期中における追加設定元本額	6,080,369,267円
同期中における一部解約元本額	5,516,283,604円

## 2024年3月11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	9,607,829,289円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	939,160,985円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,229,739,693円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,587,518,522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)	127,272,796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)	3,203,821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)	13,846,014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)	52,376,274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)	152,283,274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)	143,550,909円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	265,615,227円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,327,323,381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	27,199,941,941円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	212,938,231円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	294,622,696円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	166,879,267円
イオン・バランス戦略ファンド	63,666,776円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	53,906,980円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	192,680,176円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	199,716,157円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	781,318,037円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	466,515,767円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	554,781,185円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	56,753,284円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	1,268,750,290円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	38,660,223円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	239,112,001円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	261,141,702円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	5,553,809円
日興F W S・日本株インデックス	2,268,749,216円
三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド	108,013,501円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	7,081,484円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	4,210,049円



三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2045	5,772,166円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2055	1,698,134円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2065	1,008,963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)	612,016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)	9,287,154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)	46,028,645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)	31,664,641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)	13,824,338円
S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,228,437,226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 >	8,319,578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 >	41,808,833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 >	805,800,234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 >	1,057,665,511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 >	4,156,407,633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 >	28,176,463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 >	100,486,196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 >	573,525,116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 >	30,970,130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 >	172,458,319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 >	596,821,950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 >	382,961,981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 >	1,126,110,202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 >	24,835,775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 >	25,933,877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 >	23,786,189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 >	13,492,163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 >	60,672,294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 >	152,355,733円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 20 A 2 < 適格機関投資家専用 >	32,882,500円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 35 A 2 < 適格機関投資家専用 >	29,459,650円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 50 A 2 < 適格機関投資家専用 >	6,584,711円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 30 L 2 < 適格機関投資家専用 >	28,335,632円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 25 L 2 < 適格機関投資家専用 >	362,740,730円
S M A M ・ 国内株式インデックスファンド・ V A (適格機関投資家専用)	151,542,165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 >	145,695,201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 >	56,504,391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 >	44,183,537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 >	28,268,521円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	38,577,357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 >	20,403,150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 >	32,596,587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 >	601,941,108円
S M D A M ・ 日米3資産バランスオープン < 適格機関投資家限定 >	9,891,604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 >	92,270,018円
合 計	68,297,511,279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9月11日現在)	(2024年3月11日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	1,445,957,107	3,497,368,695
金銭信託	7,372,615	11,699,603
コール・ローン	312,106,304	472,441,253
株式	569,929,396,265	687,480,385,800
投資証券	12,160,647,103	14,388,886,059
派生商品評価勘定	14,804,960	88,855,284
未収入金	33,825,475	344,226
未収配当金	1,014,274,287	1,170,576,840
差入委託証拠金	949,230,375	2,373,375,907
流動資産合計	585,867,614,491	709,483,933,667
資産合計	585,867,614,491	709,483,933,667
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	17,124,929	2,425,143
未払解約金	156,963,106	207,651,902
その他未払費用	8,320	5,239
流動負債合計	174,096,355	210,082,284
負債合計	174,096,355	210,082,284
純資産の部		
元本等		
元本	80,285,355,686	84,457,867,457
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	505,408,162,450	624,815,983,926
元本等合計	585,693,518,136	709,273,851,383
純資産合計	585,693,518,136	709,273,851,383
負債純資産合計	585,867,614,491	709,483,933,667

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年9月12日 至 2024年3月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (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切ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(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9月11日現在)	(2024年3月11日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	80,285,355,686口	84,457,867,457口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 7.2951円 (1万口当たりの純資産額72,951円)	1口当たり純資産額 8.3980円 (1万口当たりの純資産額83,980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	(2024年3月11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)

(2023年9月11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 SEP23	2,816,973,990	-	2,819,696,609	2,722,619
	SPI 200 FUTURES SEP23	117,201,550	-	117,617,500	415,950
	FTSE 100 IDX FUT SEP23	149,809,019	-	151,117,659	1,308,640
	EURO STOXX 50 SEP23	534,513,892	-	527,743,826	6,770,066
	小計	3,618,498,451	-	3,616,175,594	2,322,857
	合 計	3,618,498,451	-	3,616,175,594	2,322,857

(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	176,716,609	-	176,719,497	2,888
	小計	176,716,609	-	176,719,497	2,888
合 計		176,716,609	-	176,719,497	2,888

(2024年3月11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 MAR24	5,926,758,185	-	5,986,666,251	59,908,066
	SPI 200 FUTURES MAR24	222,485,671	-	229,304,298	6,818,627
	FTSE 100 IDX FUT MAR24	303,352,512	-	303,802,800	450,288
	EURO STOXX 50 MAR24	1,079,983,304	-	1,101,374,633	21,391,329
	小計	7,532,579,672	-	7,621,147,982	88,568,310
	合 計	7,532,579,672	-	7,621,147,982	88,568,310

(注) 1 . 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

- 2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	642,907,722	-	640,763,028	2,144,694
	ユーロ	69,864,436	-	69,870,961	6,525
	小計	712,772,158	-	710,633,989	2,138,169
合 計		712,772,158	-	710,633,989	2,138,169

(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9月11日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	69,094,291,205円
同期中における追加設定元本額	20,220,370,634円
同期中における一部解約元本額	9,029,306,153円
2023年9月11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	39,947,626,157円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	288,872,736円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,114,280,201円

三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	815,724,504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)	31,975,460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)	866,919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)	4,357,225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)	14,119,075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)	43,555,666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)	52,652,732円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	109,889,814円
外国株式指数ファンド	1,005,322,004円
三井住友・DCつみたてN I S A・全海外株インデックスファンド	20,961,308,631円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	118,818,176円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	151,850,228円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	91,497,818円
イオン・バランス戦略ファンド	24,596,891円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	24,933,853円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	140,085,726円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	128,019,945円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	490,747,585円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	293,424,933円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	394,219,966円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	60,936,519円
三井住友D S・外国株式インデックス年金ファンド	2,210,041,998円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	11,129,714円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	55,569,565円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	53,014,111円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	3,205,314円
S M B C・DCインデックスファンド(M S C Iコクサイ)	873,388,944円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	297,199,867円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	2,316,652,259円
三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド	94,405,191円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	19,245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	30,142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)	96,982円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	1,095,017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)	5,036,135円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	2,491,452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)	1,538,674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)	353,445,856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>	2,435,607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>	14,085,258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>	390,119,752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>	598,731,327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>	2,644,112,230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>	8,840,391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>	41,243,434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 >	382,756,601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 >	31,123,233円
S M A M ・ インデックス・バランス V A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	74,041,043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 >	375,737,406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 >	243,895,256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 >	566,929,127円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	181,246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 )	177,806,517円
S M A M ・ グローバルバランス 4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	48,611,426円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	5,871,789円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	5,839,402円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	3,468,121円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	13,508,815円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	44,155,646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 >	88,244,496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 >	38,344,500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 >	170,474,139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 >	56,978,052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 >	1,469,056,578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 >	24,813,997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 >	14,256,202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 >	22,698,063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 >	128,392,752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 >	10,458,542円
合 計	80,285,355,686円

( 2024年3月11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	80,285,355,686円
同期中における追加設定元本額	8,239,999,821円
同期中における一部解約元本額	4,067,488,050円
2024年3月11日現在の元本の内訳	
三井住友・D C 外国株式インデックスファンド S	42,674,113,995円
三井住友・D C 年金バランス 3 0 ( 債券重点型 )	262,630,320円
三井住友・D C 年金バランス 5 0 ( 標準型 )	1,017,359,735円
三井住友・D C 年金バランス 7 0 ( 株式重点型 )	793,921,765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 )	41,729,345円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 2 0 ( 4 資産タイプ )	765,630円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 2 5 ( 4 資産タイプ )	3,909,208円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 3 0 ( 4 資産タイプ )	13,730,815円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 3 5 ( 4 資産タイプ )	43,252,923円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 4 0 ( 4 資産タイプ )	51,991,661円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド 2 0 4 5 ( 4 資産タイプ )	109,626,387円
外国株式指数ファンド	1,081,322,523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	22,429,217,596円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	101,651,475円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	141,007,757円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	82,230,393円
イオン・バランス戦略ファンド	42,532,888円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	27,724,448円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	137,527,552円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	132,982,852円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	518,632,989円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	320,449,253円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	446,608,982円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	63,162,793円
三井住友D S・外国株式インデックス年金ファンド	2,626,144,740円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	10,845,711円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	57,321,934円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	58,264,913円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,841,992円
S M B C・DCインデックスファンド(M S C Iコクサイ)	1,316,702,556円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	181,876,813円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	2,910,650,400円
三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド	138,237,307円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	3,163,482円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	1,998,744円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	2,834,012円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	867,273円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	520,793円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	155,364円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	2,481,010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)	12,452,005円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	8,633,008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)	3,812,447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)	290,691,569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>	2,311,319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>	11,708,833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>	300,183,498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>	521,011,278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>	2,319,958,067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>	8,008,470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>	37,259,371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>	366,150,876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>	25,858,474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>	64,805,042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>	332,318,111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>	213,719,946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>	476,810,132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)	176,004,529円
S M A M・グローバルバランス40V A <適格機関投資家限定>	40,990,345円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A <適格機関投資家専用>	4,833,474円



SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	5,585,430円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	3,245,145円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	11,300,389円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	36,517,528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>	80,441,373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>	31,231,025円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	132,919,956円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	48,871,271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>	802,311,788円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	23,417,421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>	12,599,665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>	20,272,952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>	136,627,922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>	42,014,469円
合計	84,457,867,457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9月11日現在)	(2024年3月11日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	1,630,617,357	1,485,411,747
金銭信託	1,458,905	3,351,103
コール・ローン	61,760,109	135,320,756
株式	29,711,323,555	34,879,200,458
投資信託受益証券	1,628,023,643	1,717,618,053
投資証券	2,748,434,286	3,232,969,770
派生商品評価勘定	1,294,161	80,901,538
未収入金	4,122,136	-
未収配当金	53,082,698	63,056,386
差入委託証拠金	600,754,318	600,886,254
流動資産合計	36,440,871,168	42,198,716,065
資産合計	36,440,871,168	42,198,716,065
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	69,272,629	176,184
未払金	3,795,093	-
未払解約金	10,692,240	68,572,519
その他未払費用	1,369	322
流動負債合計	83,761,331	68,749,025
負債合計	83,761,331	68,749,025
純資産の部		
元本等		

元本	20,017,222,114	21,687,014,430
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	16,339,887,723	20,442,952,610
元本等合計	36,357,109,837	42,129,967,040
純資産合計	36,357,109,837	42,129,967,040
負債純資産合計	36,440,871,168	42,198,716,065

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2023年9月12日 至 2024年3月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資信託受益証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	( 2023年9月11日現在 )	( 2024年3月11日現在 )
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	20,017,222,114口	21,687,014,430口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.8163円 ( 1万口当たりの純資産額18,163円 )	1口当たり純資産額 1.9426円 ( 1万口当たりの純資産額19,426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	( 2024年3月11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	(1) 有価証券（株式、投資信託受益証券、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、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9月11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 SEP23	2,346,365,762	-	2,278,387,728	67,978,034
	小計	2,346,365,762	-	2,278,387,728	67,978,034
合計		2,346,365,762	-	2,278,387,728	67,978,034

(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				
	台湾・ドル	210,121	-	209,597	524
	小計	210,121	-	209,597	524
	売建				
	アメリカ・ドル	210,121	-	210,031	90
	小計	210,121	-	210,031	90
合計		420,242	-	419,628	434

(2024年3月11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 MAR24	2,311,483,427	-	2,392,205,797	80,722,370
	小計	2,311,483,427	-	2,392,205,797	80,722,370
合 計		2,311,483,427	-	2,392,205,797	80,722,370

## (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	104,300,000	-	104,302,984	2,984
	小計	104,300,000	-	104,302,984	2,984
合 計		104,300,000	-	104,302,984	2,984

## (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9月11日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	14,201,860,735円
同期中における追加設定元本額	7,973,773,018円
同期中における一部解約元本額	2,158,411,639円

2023年9月11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	10,417,727,573円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	3,240,313,140円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	292,097,730円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	381,534,217円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	236,465,753円
イオン・バランス戦略ファンド	131,835,857円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	49,301,302円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	111,426,991円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	84,624,996円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	392,384,076円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	255,091,546円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	364,281,059円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	120,116,820円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	6,317,238円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	790,947,272円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	2,957,874,461円
三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド	68,386,705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DS・DCターゲットイヤーファンド2055	73,424円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	73,424円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	285,383円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	3,195,219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)	14,231,028円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	7,138,672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)	4,433,017円
SMA M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	86,918,516円
合計	20,017,222,114円

(2024年3月11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	20,017,222,114円
同期中における追加設定元本額	3,494,889,701円
同期中における一部解約元本額	1,825,097,385円
2024年3月11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	11,387,868,713円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	3,348,421,563円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	254,936,594円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	351,795,377円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	229,604,511円
イオン・バランス戦略ファンド	30,517,268円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	60,114,964円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	122,188,331円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	95,743,900円

三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	453,246,727円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	301,060,589円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	448,223,579円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	134,721,779円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	6,156,795円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	490,844,367円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	3,775,611,541円
三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド	76,895,879円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	6,903,905円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	4,307,757円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	6,171,618円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	1,860,937円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	1,120,927円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	169,640円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	2,545,908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)	12,821,891円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	8,791,967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)	3,760,972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>	70,606,431円
合計	21,687,014,430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9月11日現在)	(2024年3月11日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	1,079,562	2,106,819
コール・ローン	45,701,297	85,075,376
投資証券	13,183,983,800	13,695,086,700
未収配当金	172,193,896	204,439,756
前払金	-	430,000
差入委託証拠金	2,290,000	1,912,173
流動資産合計	13,405,248,555	13,989,050,824
資産合計	13,405,248,555	13,989,050,824
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	268,400	284,400
前受金	56,000	-
未払金	-	66,216,349
未払解約金	14,462,955	1,994,896
その他未払費用	1,380	437
流動負債合計	14,788,735	68,496,082
負債合計	14,788,735	68,496,082
純資産の部		
元本等		
元本	4,995,462,169	5,658,981,500

剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	8,394,997,651	8,261,573,242
元本等合計	13,390,459,820	13,920,554,742
純資産合計	13,390,459,820	13,920,554,742
負債純資産合計	13,405,248,555	13,989,050,824

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年9月12日 至 2024年3月11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9月11日現在)	(2024年3月11日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	4,995,462,169口	5,658,981,500口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.6805円 (1万口当たりの純資産額26,805円)	1口当たり純資産額 2.4599円 (1万口当たりの純資産額24,599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	(2024年3月11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9月11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	-	37,510,000	268,400
	小計	37,778,400	-	37,510,000	268,400
合計		37,778,400	-	37,510,000	268,400

(2024年3月11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 0606月	33,824,400	-	33,540,000	284,400
	小計	33,824,400	-	33,540,000	284,400
合計		33,824,400	-	33,540,000	284,400

## (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9月11日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	3,618,768,466円
同期中における追加設定元本額	2,796,296,809円



同期中における一部解約元本額	1,419,603,106円
2023年9月11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)	235,220,778円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	316,152,868円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	142,329,717円
イオン・バランス戦略ファンド	65,920,793円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	2,510,623,916円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	19,066,545円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	39,063,929円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	38,725,679円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	160,007,336円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	98,903,746円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	74,867,373円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	39,990,515円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,447,550円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	233,155,759円
日興FWS・Jリートインデックス	589,430,782円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	60,690,538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)	122,781円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	1,912,971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)	9,735,376円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	5,209,846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)	3,448,069円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	3,148,468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>	79,713,693円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	49,281,384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>	79,401,552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>	136,795,174円
合計	4,995,462,169円

(2024年3月11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	4,995,462,169円
同期中における追加設定元本額	1,621,563,793円
同期中における一部解約元本額	958,044,462円
2024年3月11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)	223,670,880円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	359,312,135円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	188,982,889円

イオン・バランス戦略ファンド	23,231,595円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	2,657,062,760円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	27,468,328円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	44,853,288円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	47,667,450円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	210,195,479円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	137,432,696円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	106,355,358円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	50,043,713円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,814,919円
三井住友D S・国内リートインデックス年金ファンド	320,329,158円
日興FWS・Jリートインデックス	886,735,569円
三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド	78,895,541円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	2,077,275円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	1,408,169円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	2,418,937円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	848,272円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	500,323円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	297,898円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	9,009,894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)	53,236,137円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	39,962,063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)	18,164,965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>	2,929,952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>	69,181,938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>	36,290,409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>	57,603,510円
合計	5,658,981,500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9月11日現在)	(2024年3月11日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	836,911,495	1,105,466,215
金銭信託	537,925	569,550
コール・ローン	22,772,077	22,998,985
投資証券	28,657,250,207	33,109,296,986
派生商品評価勘定	52,940	344,061
未収入金	3,187,911	1,966,319
未収配当金	57,921,581	72,979,487
流動資産合計	29,578,634,136	34,313,621,603
資産合計	29,578,634,136	34,313,621,603
負債の部		
流動負債		

派生商品評価勘定	148,153	254,929
未払解約金	14,568,268	1,495,861
その他未払費用	686	262
流動負債合計	14,717,107	1,751,052
負債合計	14,717,107	1,751,052
純資産の部		
元本等		
元本	9,979,027,630	10,582,375,566
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	19,584,889,399	23,729,494,985
元本等合計	29,563,917,029	34,311,870,551
純資産合計	29,563,917,029	34,311,870,551
負債純資産合計	29,578,634,136	34,313,621,603

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年9月12日 至 2024年3月11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9月11日現在)	(2024年3月11日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	9,979,027,630口	10,582,375,566口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.9626円 (1万口当たりの純資産額29,626円)	1口当たり純資産額 3.2424円 (1万口当たりの純資産額32,424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	(2024年3月11日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## （デリバティブ取引に関する注記）

（2023年9月11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	24,700,000	-	24,554,557	145,443
	小計	24,700,000	-	24,554,557	145,443
	売建				
	アメリカ・ドル	11,000,000	-	11,002,710	2,710
	オーストラリア・ドル	20,100,000	-	20,047,060	52,940
	小計	31,100,000	-	31,049,770	50,230
	合計	55,800,000	-	55,604,327	95,213

（2024年3月11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	69,700,000	-	69,605,098	94,902
	イギリス・ポンド	34,200,000	-	34,041,543	158,457

市場取引以外 の取引	小計	103,900,000	-	103,646,641	253,359
	売建				
	オーストラリア・ド ル	24,600,000	-	24,440,444	159,556
	ユーロ	17,800,000	-	17,617,065	182,935
	小計	42,400,000	-	42,057,509	342,491
	合 計	146,300,000	-	145,704,150	89,132

## (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9月11日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	8,375,587,967円
同期中における追加設定元本額	2,826,749,138円
同期中における一部解約元本額	1,223,309,475円
2023年9月11日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	13,398,410円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	19,774,737円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	57,234,466円
イオン・バランス戦略ファンド	40,172,185円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	8,031,891,206円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	8,150,712円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	34,590,661円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	35,439,615円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	145,174,840円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	90,253,464円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	66,931,443円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	111,536,949円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,051,013円

三井住友D S ・外国リートインデックス年金ファンド	348,394,851円
日興F W S ・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	89,672,010円
日興F W S ・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	622,235,622円
三井住友D S ・先進国リートインデックス・ファンド	113,400,205円
三井住友D S ・D Cターゲットイヤーファンド2 0 3 5	7,339円
三井住友D S ・D Cターゲットイヤーファンド2 0 4 0	7,706円
三井住友D S ・D Cターゲットイヤーファンド2 0 4 5	9,541円
三井住友D S ・D Cターゲットイヤーファンド2 0 5 5	11,376円
三井住友D S ・D Cターゲットイヤーファンド2 0 6 5	11,376円
三井住友D S ・F W専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	30,436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)	350,802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)	1,627,905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)	790,005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)	505,663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>	34,040,769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>	40,920,094円
S M D A M ・リスクコントロール型バランスファンド2 0 2 1 0 5(リスク3%) <適格機関投資家限定>	71,412,229円
合 計	9,979,027,630円

(2024年3月11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	9,979,027,630円
同期中における追加設定元本額	1,242,861,625円
同期中における一部解約元本額	639,513,689円
2024年3月11日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	19,062,981円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	27,082,042円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	39,629,837円
イオン・バランス戦略ファンド	36,519,630円
三井住友・D C外国リートインデックスファンド	8,361,060,857円
三井住友D S ・D Cターゲットイヤーファンド2 0 5 0	9,910,853円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	35,891,483円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	37,046,206円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	161,272,338円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	104,592,996円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	81,569,226円
三井住友・D CつみたてN I S A ・世界分散ファンド	120,982,373円
三井住友D S ・D Cターゲットイヤーファンド2 0 6 0	1,000,874円
三井住友D S ・外国リートインデックス年金ファンド	375,595,893円
日興F W S ・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	67,455,152円
日興F W S ・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	897,187,153円
三井住友D S ・先進国リートインデックス・ファンド	121,316,673円
三井住友D S ・D Cターゲットイヤーファンド2 0 3 5	1,296,045円
三井住友D S ・D Cターゲットイヤーファンド2 0 4 0	690,096円
三井住友D S ・D Cターゲットイヤーファンド2 0 4 5	984,784円
三井住友D S ・D Cターゲットイヤーファンド2 0 5 5	299,739円

三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	177,051円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	43,316円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	538,158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)	3,334,055円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	2,243,162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)	994,144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>	32,153,468円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	42,444,981円
合計	10,582,375,566円

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

2024年3月29日現在

資産総額	2,758,742,320円
負債総額	4,753,614円
純資産総額（ - ）	2,753,988,706円
発行済口数	1,777,404,973口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	1.5494円 (15,494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

	2024年3月29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。

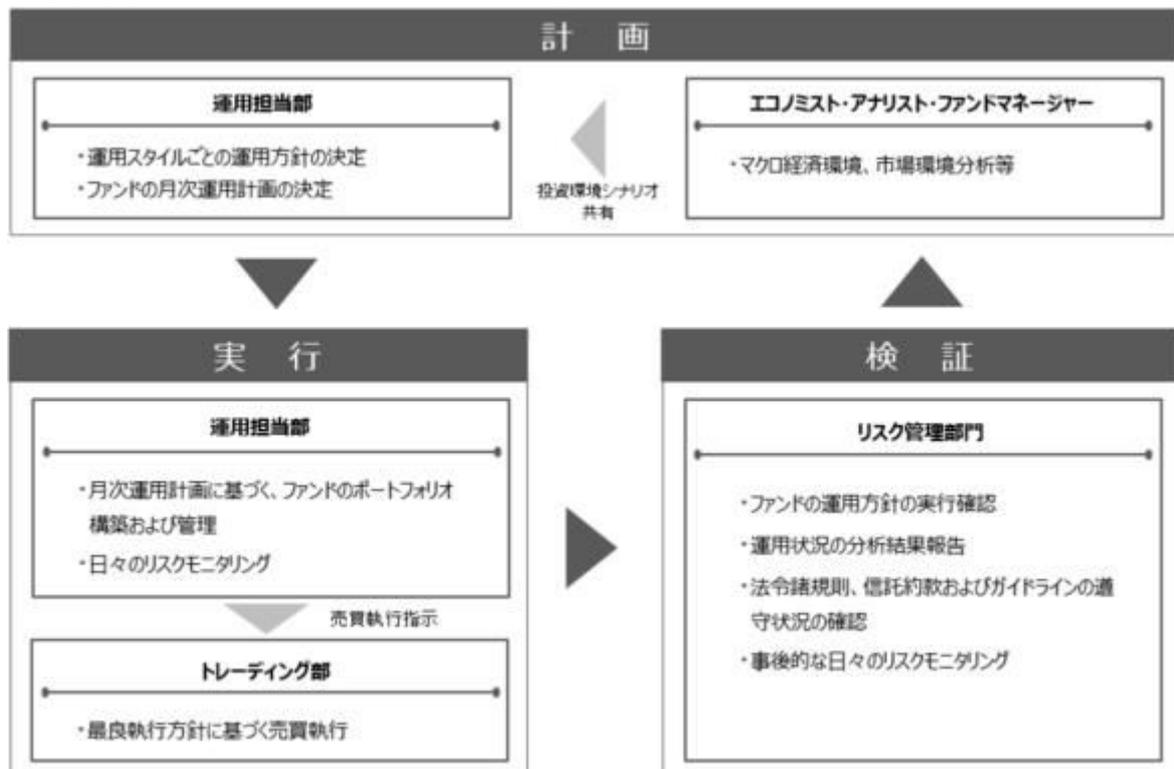
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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。

2024年3月29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	685	12,568,560
単位型株式投資信託	94	660,549
追加型公社債投資信託	1	25,689
単位型公社債投資信託	157	248,446
合計	937	13,503,245

### 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 hands 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	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	-	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	4,727,024	未払 手数料	1,098,966
親会社の 子会社	SMBC日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	-	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	8,397,864	未払 手数料	1,661,614

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

## 2. 親会社に関する注記

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

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の 子会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	-	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	5,279,199	未払 手数料	1,265,651
親会社の 子会社	SMBC日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	-	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	7,030,381	未払 手数料	1,288,749

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

## 2. 親会社に関する注記

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

## (1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり純資産額	2,613.28円	2,587.21円
1株当たり当期純利益	121.61円	61.91円

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。



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)	
<b>資産の部</b>	
<b>流動資産</b>	
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
<b>固定資産</b>	
有形固定資産	1 1,897,269
<b>無形固定資産</b>	
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
<b>投資その他の資産</b>	
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
<b>負債の部</b>	
<b>流動負債</b>	
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、記載していません。

#### 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
PayPay銀行株式会社	72,216	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。
株式会社みなと銀行	39,984	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。
a uカブコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社S B I証券	48,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
岡三証券株式会社	5,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
Jトラストグローバル証券株式会社	3,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
静岡東海証券株式会社	600	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	19,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
フィリップ証券株式会社	950	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
S M B C日興証券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	12,200	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
播陽証券株式会社	112	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,945	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
岡三にいがた証券株式会社	852	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
住友生命保険相互会社	639,000	保険業法に基づき、生命保険業を営んでいます。

Jトラストグローバル証券株式会社の資本金の額は、2022年12月末現在です。

楽天証券株式会社の資本金の額は、2022年12月末現在です。

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

## 2【関係業務の概要】

### イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

### 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。）

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

## 第3【その他】

### 1 目論見書の表紙から本文の前までおよび裏表紙の記載について

（1）「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨を記載することがあります。

（2）委託会社の金融商品取引業者登録番号を記載することがあります。

（3）委託会社のホームページのアドレスおよび他のインターネットのアドレス（これらのアドレスをコード化した図形等も含む）を記載することがあります。

（4）請求目論見書の入手方法および投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨を記載することがあります。

- (5) 目論見書の使用開始日を記載することがあります。
  - (6) 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。
  - (7) 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきであること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11月29日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

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」に掲げられている三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンドの2022年9月13日から2023年9月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンドの2023年9月11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9月12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11月29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、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

**財務諸表監査における監査人の責任**

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

えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

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

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

#### 利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。  
2. 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5月29日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

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」に掲げられている三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンドの2023年9月12日から2024年3月11日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンドの2024年3月11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9月12日から2024年3月11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9月11日をもって終了した前計算期間の中間計算期間（2022年9月13日から2023年3月12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5月30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。