【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7月11日提出
【発行者名】	三井住友ＤＳ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ターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ）
【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】	5兆円を上限とします。
【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ターゲットイヤーファンド2040（４資産タイプ）
以下「当ファンド」といいます。また、「＜2040＞」という略称でいうことがあります。

（2）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。
＊ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第２条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社である三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。
当初元本は１口当たり１円です。委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

（3）【発行（売出）価額の総額】

5兆円を上限とします。

（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、「ＤＣ2040」として掲載されます。
委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

（5）【申込手数料】

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7月12日から2025年1月9日まで
申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

（８）【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。
販売会社の詳細につきましては、前記「（４）発行（売出）価格」に記載の委託会社にお問い合わせください。

（９）【払込期日】

取得申込者は、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）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　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。
ニ　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、国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）、国内債券パッシブ・マザーファンド、外国株式インデックス・マザーファンド、外国債券パッシブ・マザーファンドおよびマネーインカム・マザーファンドの受益証券への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債および短期金融資産に分散投資を行うことにより、西暦2040年（以下「ターゲットイヤー」といいます。）に向けて、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。ターゲットイヤー到達後は、安定した収益の獲得を目指します。

※以下、上記各マザーファンドを総称して、あるいはそれぞれを「マザーファンド」ということがあります。

ロ　委託会社は、受託会社と合意の上、金１兆円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。

ハ　当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

（イ）当ファンドが該当する商品分類

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

（ロ）当ファンドが該当する属性区分

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、円短期金融資産）資産配分変更型））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式、債券および円短期金融資産であり、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	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

≪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)
単位型	国内	株式
追加型	海外	債券
	内外	不動産投信
		その他資産 (　)
		資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

≪属性区分表≫

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

（https://www.toushin.or.jp/）をご覧ください。

（２）【ファンドの沿革】

2008年３月31日	信託契約締結、設定、運用開始。
2017年１月13日	「スミセイ・ＤＣターゲットイヤーファンド2040」から「三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド2040（４資産タイプ）」に名称を変更。

（３）【ファンドの仕組み】

イ　当ファンドの関係法人とその役割

（イ）委託会社　「三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社」

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

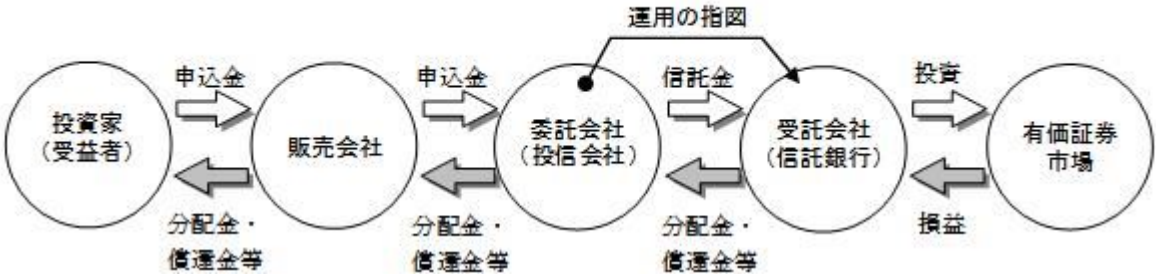
（ロ）受託会社　「三井住友信託銀行株式会社」

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

（ハ）販売会社

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

運営の仕組み



ロ　委託会社の概況

（イ）資本金の額

20億円（2024年4月30日現在）

（ロ）会社の沿革

1985年７月15日	三生投資顧問株式会社設立
1987年２月20日	証券投資顧問業の登録
1987年６月10日	投資一任契約にかかる業務の認可
1999年１月１日	三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合
1999年２月５日	三生投資顧問株式会社から三井生命グローバルアセットマネジメント株式会社へ商号変更
2000年１月27日	証券投資信託委託業の認可取得

2002年12月１日　住友ライフ・インベストメント株式会社、スミセイ グローバル投信株式会社、三井住友海上アセットマネジメント株式会社およびさくら投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友アセットマネジメント株式会社に商号変更
2013年４月１日　トヨタアセットマネジメント株式会社と合併
2019年４月１日　大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友ＤＳアセットマネジメント株式会社に商号変更

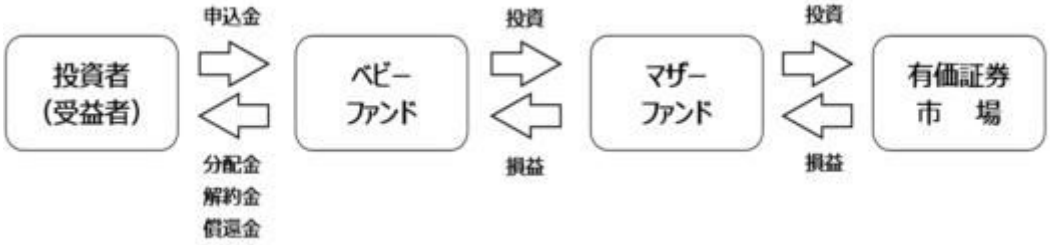
（ハ）大株主の状況

（2024年4月30日現在）

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

ハ　ファンドの運用形態（ファミリーファンド方式による運用）

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



2【投資方針】

（１）【投資方針】

「（１）投資方針」には、当ファンドと実質的な投資対象資産が同じで、ターゲットイヤーおよび基本資産配分比率が異なる「三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド2020（４資産タイプ）（以下、「＜2020＞」ということがあります。）」、「三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド2025（４資産タイプ）（以下、「＜2025＞」ということがあります。）」、「三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド2030（４資産タイプ）（以下、「＜2030＞」ということがあります。）」、「三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド2035（４資産タイプ）（以下、「＜2035＞」ということがあります。）」および「三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド2045（４資産タイプ）（以下、「＜2045＞」ということがあります。）」の情報を合わせて説明している部分があります。

イ　基本方針

当ファンドは、マザーファンドの受益証券への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社

債および短期金融資産に分散投資を行うことにより、ターゲットイヤーに向けて、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。ターゲットイヤー到達後は、安定した収益の獲得を目指します。

ロ　投資態度

（イ）国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融資産を主要投資対象とする５つのマザーファンドに分散投資を行います。

国内株式	**国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）**
国内債券	**国内債券パッシブ・マザーファンド**
外国株式	**外国株式インデックス・マザーファンド**
外国債券	**外国債券パッシブ・マザーファンド**
短期金融資産	**マネーインカム・マザーファンド**

（ロ）長期的な視点に基づき時間的経過に従い資産配分を変更し、値上がり益の獲得と配当等収益の獲得により、信託財産の着実な成長を目指した運用を目指します。

（ハ）基本資産配分は、西暦2040年をターゲットイヤーとし、ターゲットイヤーまでの残存期間が長いほど値上がり益の獲得を重視し、ターゲットイヤーに近づくに従い配当等収益を重視した比率とし、原則として年１回決算時に変更します。

なお、ターゲットイヤー到達後は、主として国内債券パッシブ・マザーファンドおよびマネーインカム・マザーファンドに投資することにより安定した収益の獲得を目指します。

（ニ）組入資産の時価変動により生ずる実際の資産構成比率と基本資産配分との乖離は、資産毎に必要に応じて調整を行うものとします。

[2024年４月現在の基本資産配分]

国内株式	外国株式	外国債券	国内債券	短期金融資産
25.0%	16.0%	20.0%	37.0%	2.0%

<2040><2045>の運用にあたっては、各マザーファンドが運用の対象とする指数から基本資産配分比率に基づき作成した合成指数を参考指数とします。
各マザーファンドは、それぞれの対象指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行うため、<2040><2045>は結果として参考指数の動きに連動する成果を目指して運用を行います。

（ホ）実質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。

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

ファンドの特色

1 日本を含む世界各国の株式、公社債および短期金融資産に分散投資を行います。

□実際の運用は、各資産に投資する5つのマザーファンドへの投資を通じて行います（ファミリーファンド方式）。

□ターゲットイヤー到達後は、主として国内債券パッシブ・マザーファンドおよびマネーインカム・マザーファンドで運用を行います。

2 基本資産配分は、ターゲットイヤーまでの残存期間が長いほど値上がり益の獲得を重視し、ターゲットイヤーに近づくに従い配当等収益を重視した比率とします。
基本資産配分は、原則として年1回決算時に変更します。

3 実質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。

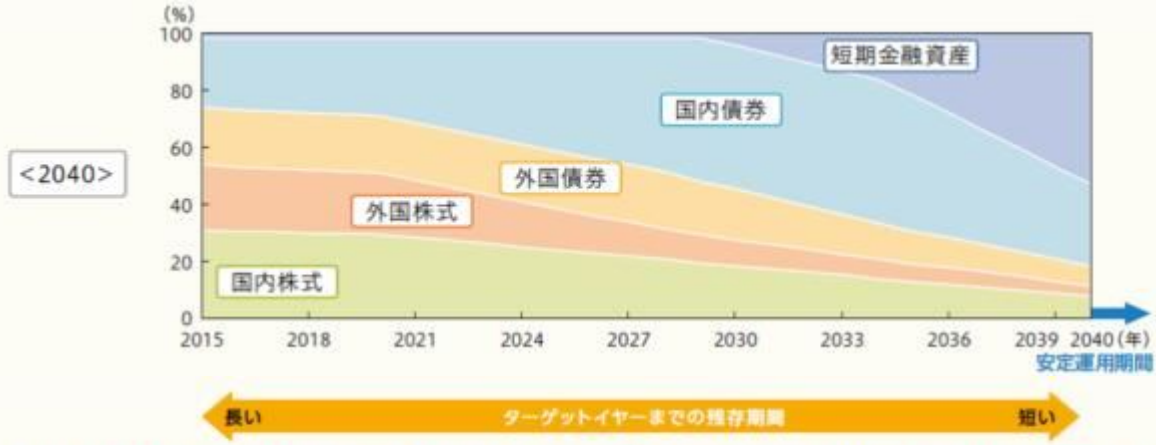
※資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

ファンドのしくみ

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

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

▶ターゲットイヤーまでの基本資産配分のイメージ



※上記は、各決算時点での基本資産配分を表しています。各ターゲットイヤーの前年の決算日から翌年の決算日までは、安定運用期間に向けて、順次、国内株式、外国株式および外国債券への配分を低減していきます。また、現時点で予定している基本資産配分をもとに作成したイメージであり、将来、実際に上記の通りの運用を行うことを保証するものではありません。

各マザーファンドの運用プロセス

▶国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

- 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。
- TOPIX（東証株価指数）採用銘柄の中から、原則として投資不適格銘柄および低流動性銘柄を除外した上で、最適化法により、ポートフォリオを構築します。

▶国内債券パッシブ・マザーファンド

- 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－BPI（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。
- 層化抽出法により、ファンド規模に応じデュレーション、満期構成、セクター（債券種別）配分、事業債の格付け構成および業種を可能な限りNOMURA－BPI（総合）に近づけたポートフォリオを構築します。

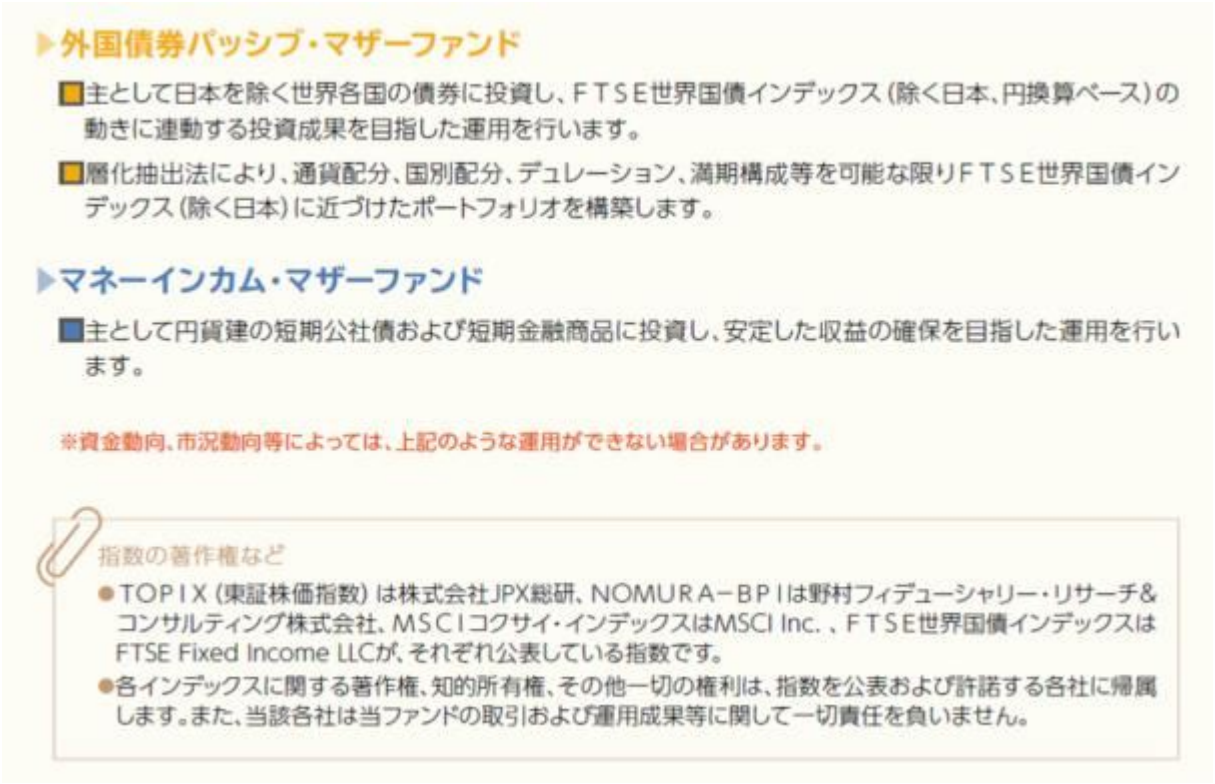
▶外国株式インデックス・マザーファンド

- 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。
- MSCIコクサイ・インデックス構成銘柄の中から、原則として投資不適格銘柄および低流動性銘柄を除外した上で、最適化法により、ポートフォリオを構築します。

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

層化抽出法とは
指数を構成する銘柄をいくつかのグループ（層）に分け、それぞれのグループから代表銘柄を抽出してポートフォリオを構築する方法です。指数を構成するすべての銘柄を保有する完全法に比べて、少ない銘柄数でポートフォリオを構築することができるため、銘柄入れ替えに伴う取引コストの抑制や、低流動性銘柄の組入れを避けることができるというメリットがあり、債券パッシブ運用に適しています。

デュレーションとは
「債券の投資元本の回収に要する平均残存期間」や「金利の変動に対する債券価格の変動性」を表す指標です。一般的に、この値が長い（大きい）ほど、金利の変動に対する債券価格の変動が大きくなります。



（２）【投資対象】

イ　投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

１．有価証券
２．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、マザーファンド受益証券および次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

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

10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第18号で定めるものをいいます。）
16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
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

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。

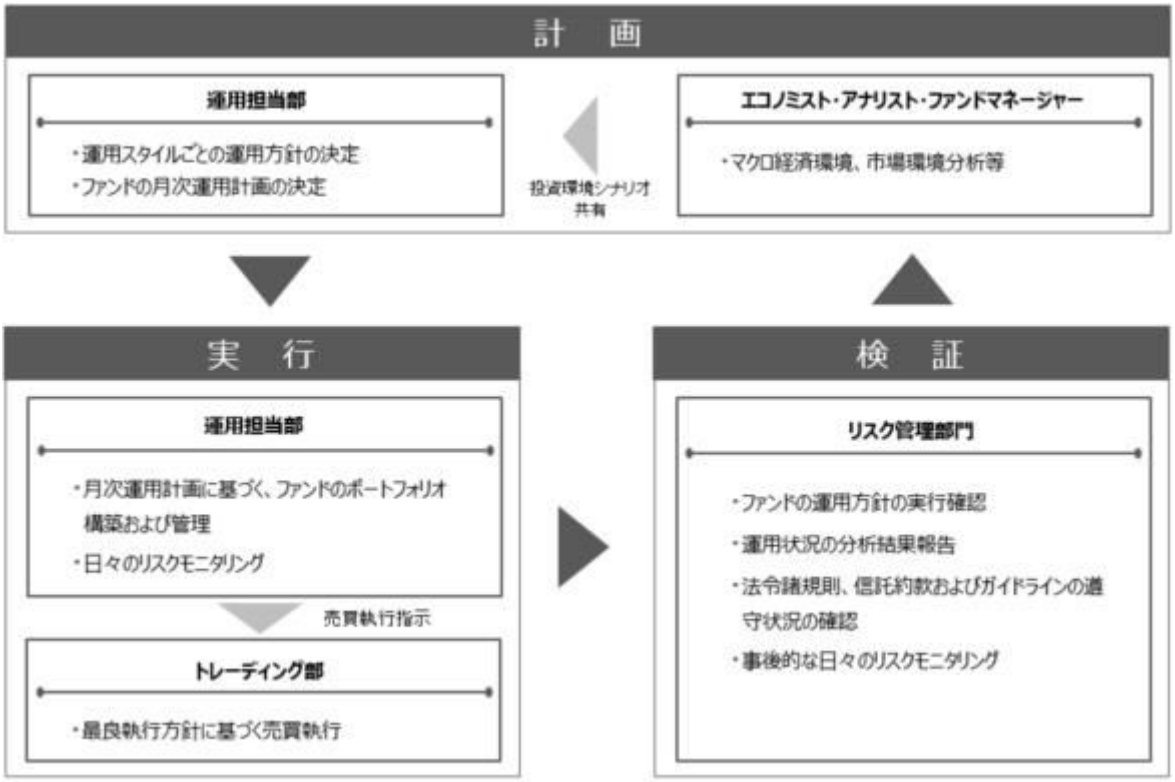
ハ　投資対象とする金融商品

委託会社は、信託金を、上記ロ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。

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

（４）【分配方針】

毎年１回（原則として４月13日。休業日の場合は翌営業日となります。）決算を行い、原則として以下の方針に基づき分配金額を決定します。

イ　分配対象額は、経費控除後の配当等収益と有価証券売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

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、分配対象収益が少額の場合等には、委託会社の判断により収益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、前記「（１）投資方針」に基づいて運用を行います。

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】

Ⅰ　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は、信託財産の純資産総額の70%以下とします。
※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　新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

ハ　マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の５%以下とします。

ニ　外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%以下とします。

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。

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。

II　ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

イ　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。

ロ　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）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。

ハ　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。

ニ　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合計額が、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）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。

（ホ）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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

ホ　金利先渡取引および為替先渡取引の指図

（イ）委託会社は、金利先渡取引および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）金利先渡取引および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）金利先渡取引および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および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、金利先渡取引および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および為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

（ニ）金利先渡取引および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。

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

（ト）「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。

ヘ　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）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たときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

ト　有価証券の空売りの指図

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

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

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

チ　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たときは、担保の提供の指図をするものとします。

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

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

（ニ）借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

リ　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。

ヌ　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）上記（イ）の予約取引の指図は、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。

ル　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、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

（ロ）一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が５営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。

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

（ニ）借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

ヲ　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。

III　法令に基づく投資制限

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

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

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

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

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

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

（参考情報：マザーファンドの投資方針等）

（国内株式インデックス・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

前記「２　投資方針　（２）投資対象　ロ　投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号のうち、第１号、第２号、第４号、第10号、第13号、第18号および第19号に掲げるものならびに短期社債等に投資します。

ハ　投資対象とする金融商品

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

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

（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－ＢＰＩ（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－ＢＰＩ（総合）をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。

（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

前記「２　投資方針　（２）投資対象　ロ　投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号（第１号から第21号）に掲げるものに投資します。

ハ　投資対象とする金融商品

前記「２　投資方針　（２）投資対象　ハ　投資対象とする金融商品」において記載した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（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、原則として対円での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

前記「２　投資方針　（２）投資対象　ロ　投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号のうち、第１号、第２号、第４号、第５号、第10号から第21号に掲げるものに投資します（ただし、第14号に掲げるもののうち投資法人債券を除きま

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。

（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

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

ロ　投資態度

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

（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

前記「２　投資方針　（２）投資対象　ロ　投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号（第１号から第21号）に掲げるものに投資します（ただし、第14号に掲げるもののうち投資法人債券を除きます。）。

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。

（マネーインカム・マザーファンド）

（１）投資方針等

イ　基本方針

円貨建の短期公社債および短期金融商品を主要投資対象とし、安定した収益の確保を目指します。

ロ　投資態度

（イ）主として、円貨建の短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指します。

（ロ）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

前記「２　投資方針　（２）投資対象　ロ　投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号（第１号から第21号）に掲げるものに投資します。

ハ　投資対象とする金融商品

前記「２　投資方針　（２）投資対象　ハ　投資対象とする金融商品」において記載した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（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

（ロ）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%以下とします。

（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。

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）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。

（ニ）為替変動リスク

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

（ホ）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。

（ヘ）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。

ロ　その他の留意点

（イ）投資信託に関する留意点

・当ファンドは「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、換金申込みの受付けが中止となる可能性、既に受け付けた換金申込みが取り消しとなる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性等があります。

（ロ）分配金に関する留意事項

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

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

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

ハ　投資リスクの管理体制

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

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

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

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

※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は異なります。
※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

日本株	**TOPIX（東証株価指数、配当込み）** 株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社が算出、公表する指数で、日本の株式を対象としています。
先進国株	**MSCIコクサイ・インデックス（グロス配当込み、円ベース）** MSCI Inc.が開発した指数で、日本を除く世界の主要先進国の株式を対象としています。
新興国株	**MSCIエマージング・マーケット・インデックス（グロス配当込み、円ベース）** MSCI Inc.が開発した指数で、新興国の株式を対象としています。
日本国債	**NOMURA-BPI（国債）** 野村フィデューシャリー・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・マーケッツ・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】

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

決算期	信託報酬率	配分（税抜き）		
		委託会社	販売会社	受託会社
第１期～第32期（ターゲットイヤーの決算日まで）	年0.462%（税抜き0.42%）	年0.19%	年0.2%	年0.03%
第33期以降（ターゲットイヤーの決算翌日以降）	年0.231%（税抜き0.21%）	年0.08%	年0.1%	年0.03%

※上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。

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

（４）【その他の手数料等】

イ　信託財産の財務諸表の監査に要する費用（消費税等相当額を含みます。）は、原則として、計算期間を通じて毎日、信託財産の費用として計上され、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

ロ　信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、信託財産中から支弁します。

ハ　有価証券の売買時の手数料、デリバティブ取引等に要する費用、および外国における資産の保管等に要する費用等（それらにかかる消費税等相当額を含みます。）は、信託財産中から支弁するものとします。

※　上記にかかる費用に関しましては、変更される場合があるものや、その時々の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金額を認識するものがあったりすることから、あらかじめ具体的に記載することはできません。

（５）【課税上の取扱い】

イ　個別元本について

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

（ロ）受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合については、各販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本の算出が行われることがあります。

（ハ）受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の（収益分配金の課税について）を参照。）

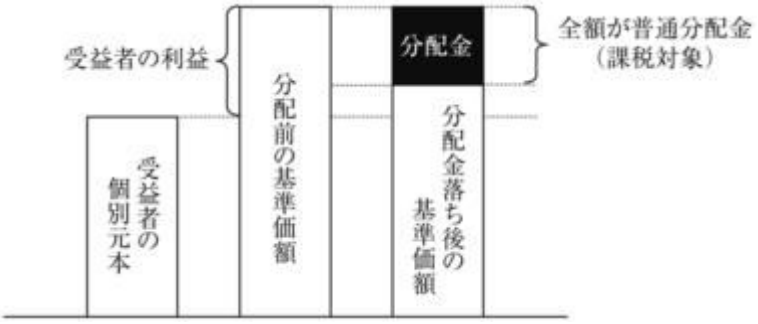
ロ　一部解約時および償還時の課税について

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

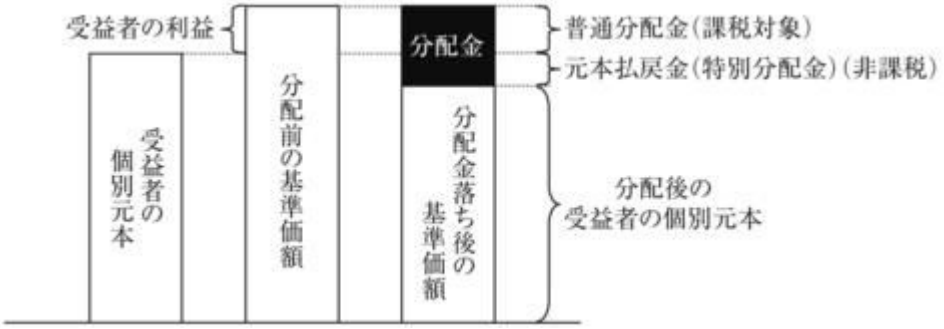
ハ　収益分配金の課税について

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

①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。



②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①、②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。

ニ　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

ⅰ．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。

ⅱ．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ます。）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「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4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(2023年4月14日～2024年4月15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
<2020>	0.24%	0.23%	0.01%
<2025>	0.47%	0.46%	0.01%
<2030>	0.47%	0.46%	0.01%
<2035>	0.48%	0.46%	0.02%
<2040>	0.48%	0.46%	0.02%
<2045>	0.48%	0.46%	0.02%

※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。

※上記の「（参考情報）総経費率」は、当ファンドと実質的な投資対象資産が同じで、ターゲットイヤーおよび基本資産配分比率が異なる「＜2020＞」、「＜2025＞」、「＜2030＞」、「＜2035＞」お

よび「＜2045＞」の情報を合わせて説明しています。

5【運用状況】

（1）【投資状況】

三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ）

2024年4月30日現在

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	2,560,741,437	99.35
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	16,880,588	0.65
合計（純資産総額）		2,577,622,025	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】

①【投資有価証券の主要銘柄】

三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ）

イ　主要投資銘柄

2024年4月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価（円）	帳簿価額（円）	評価額単価（円）	評価額（円）	投資比率（%）
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	782,342,686	1.2006	939,298,980	1.1997	938,576,520	36.41
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）	130,426,020	4.9017	639,309,328	4.8847	637,091,979	24.72
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	225,047,509	2.2605	508,724,220	2.3056	518,869,536	20.13
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	46,862,617	8.7359	409,387,137	8.9566	419,729,715	16.28
日本	親投資信託受益証券	マネーインカム・マザーファンド	46,136,888	1.0073	46,473,885	1.0073	46,473,687	1.80

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ　種類別投資比率

2024年4月30日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	99.35
合　計	99.35

②【投資不動産物件】

三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ）

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ）

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ）

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7期　（2015年 4月13日）	81,578,616	81,578,616	14,379	14,379
第8期　（2016年 4月13日）	178,916,663	178,916,663	13,267	13,267
第9期　（2017年 4月13日）	236,077,626	236,077,626	14,009	14,009
第10期　（2018年 4月13日）	331,831,432	331,831,432	15,438	15,438
第11期　（2019年 4月15日）	494,351,089	494,351,089	15,763	15,763
第12期　（2020年 4月13日）	654,089,367	654,089,367	15,101	15,101
第13期　（2021年 4月13日）	1,128,084,404	1,128,084,404	18,451	18,451
第14期　（2022年 4月13日）	1,552,941,959	1,552,941,959	19,041	19,041
第15期　（2023年 4月13日）	1,987,624,666	1,987,624,666	19,438	19,438
第16期　（2024年 4月15日）	2,562,988,538	2,562,988,538	22,836	22,836
2023年 4月末日	2,012,969,849	-	19,662	-
5月末日	2,115,974,157	-	20,092	-
6月末日	2,228,634,170	-	20,921	-
7月末日	2,228,577,361	-	20,851	-
8月末日	2,259,860,154	-	20,987	-
9月末日	2,261,212,430	-	20,813	-
10月末日	2,243,944,622	-	20,404	-
11月末日	2,360,488,094	-	21,249	-
12月末日	2,378,459,864	-	21,327	-
2024年 1月末日	2,467,074,109	-	21,999	-
2月末日	2,538,597,741	-	22,540	-
3月末日	2,598,944,601	-	23,009	-
4月末日	2,577,622,025	-	22,971	-

②【分配の推移】

三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ）

	計算期間	１万口当たり分配金（円）
第7期	2014年 4月15日～2015年 4月13日	0
第8期	2015年 4月14日～2016年 4月13日	0
第9期	2016年 4月14日～2017年 4月13日	0
第10期	2017年 4月14日～2018年 4月13日	0
第11期	2018年 4月14日～2019年 4月15日	0
第12期	2019年 4月16日～2020年 4月13日	0
第13期	2020年 4月14日～2021年 4月13日	0
第14期	2021年 4月14日～2022年 4月13日	0
第15期	2022年 4月14日～2023年 4月13日	0
第16期	2023年 4月14日～2024年 4月15日	0

③【収益率の推移】

三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ）

	収益率（％）
第7期	22.2
第8期	△7.7
第9期	5.6
第10期	10.2
第11期	2.1
第12期	△4.2
第13期	22.2
第14期	3.2
第15期	2.1
第16期	17.5

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

（４）【設定及び解約の実績】

三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第7期	44,831,283	3,281,608
第8期	84,680,093	6,563,135
第9期	49,340,920	15,674,791
第10期	53,950,215	7,519,004
第11期	113,641,120	14,980,754
第12期	141,241,710	21,719,594
第13期	234,642,524	56,388,973
第14期	268,501,784	64,304,794
第15期	267,928,064	60,966,302

第16期	208,134,656	108,349,775

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

(参考)

（１）投資状況

国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）

2024年4月30日現在

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	329,683,154,620	98.12
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	6,304,810,962	1.88
合計（純資産総額）		335,987,965,582	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	6,373,040,000	1.90
合計	買建	-	6,373,040,000	1.90

国内債券パッシブ・マザーファンド

2024年4月30日現在

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	106,454,960,450	80.12
地方債証券	日本	8,571,311,400	6.45
特殊債券	日本	10,327,095,056	7.77
社債券	日本	7,035,205,500	5.29
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	481,512,963	0.37
合計（純資産総額）		132,870,085,369	100.00

外国株式インデックス・マザーファンド

2024年4月30日現在

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	542,454,086,844	70.40
	イギリス	29,338,960,113	3.81
	カナダ	25,469,872,244	3.31
	フランス	23,335,851,619	3.03
	スイス	22,084,473,478	2.87
	ドイツ	18,134,169,711	2.35
	オランダ	15,200,582,989	1.97
	アイルランド	13,760,164,678	1.79
	オーストラリア	13,492,565,078	1.75
	デンマーク	7,752,402,354	1.01
	スウェーデン	6,498,105,079	0.84
	スペイン	5,558,270,280	0.72
	イタリア	4,326,554,573	0.56

	香港	3,088,195,185	0.40
	ジャージィー	2,412,917,303	0.31
	シンガポール	2,266,402,219	0.29
	フィンランド	2,135,904,589	0.28
	ベルギー	1,647,511,354	0.21
	イスラエル	1,491,312,355	0.19
	ノルウェー	1,291,089,502	0.17
	ケイマン諸島	1,025,241,298	0.13
	バミューダ	966,834,233	0.13
	オランダ領キュラソー	881,288,253	0.11
	ニュージーランド	560,767,013	0.07
	リベリア	432,633,901	0.06
	オーストリア	401,556,566	0.05
	ルクセンブルグ	380,168,031	0.05
	ポルトガル	355,161,677	0.05
	パナマ	201,342,074	0.03
	マン島	67,959,438	0.01
	小計	747,012,344,031	96.95
投資証券	アメリカ	12,006,578,971	1.56
	オーストラリア	1,334,852,953	0.17
	フランス	300,867,161	0.04
	イギリス	271,633,008	0.04
	シンガポール	266,695,937	0.03
	香港	128,354,486	0.02
	ベルギー	59,096,974	0.01
	カナダ	54,947,776	0.01
	ケイマン諸島	47,812,032	0.01
	小計	14,470,839,298	1.88
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	9,052,212,440	1.17
合計（純資産総額）		770,535,395,769	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	418,176,920	0.05
株価指数先物取引	買建	ドイツ	1,442,022,400	0.19
株価指数先物取引	買建	アメリカ	7,914,130,140	1.03
株価指数先物取引	買建	オーストラリア	256,285,458	0.03
合計	買建	-	10,030,614,918	1.30

種類	買建／売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	-	1,418,863,277	0.18

外国債券パッシブ・マザーファンド

2024年4月30日現在

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	86,674,620,224	46.31
	中国	17,164,625,500	9.17
	フランス	14,664,108,530	7.83
	イタリア	13,399,160,334	7.16
	ドイツ	11,571,383,534	6.18
	イギリス	9,405,071,335	5.02
	スペイン	8,998,817,935	4.81
	カナダ	3,757,586,349	2.01
	ベルギー	3,230,757,500	1.73
	オランダ	2,720,266,298	1.45
	オーストラリア	2,505,883,980	1.34
	オーストリア	2,209,845,556	1.18
	メキシコ	1,538,859,415	0.82
	ポーランド	1,035,704,060	0.55
	フィンランド	951,117,212	0.51
	アイルランド	942,778,124	0.50
	マレーシア	909,883,502	0.49
	シンガポール	750,815,830	0.40
	イスラエル	566,715,419	0.30
	デンマーク	490,934,246	0.26
	ニュージーランド	455,299,438	0.24
	スウェーデン	351,039,184	0.19
	ノルウェー	307,237,218	0.16
	小計	184,602,510,723	98.62
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	2,576,216,810	1.38
合計（純資産総額）		187,178,727,533	100.00

マネーインカム・マザーファンド

2024年4月30日現在

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	470,197,700	24.12
特殊債券	日本	801,262,300	41.10
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	678,262,140	34.78
合計（純資産総額）		1,949,722,140	100.00

（２）投資資産

①投資有価証券の主要銘柄

国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）

イ　主要投資銘柄（上位30銘柄）

2024年4月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	4,669,500	2,805.03	13,098,103,811	3,638.00	16,987,641,000	5.06
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	5,099,600	1,258.83	6,419,542,576	1,579.50	8,054,818,200	2.40
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	601,500	12,827.04	7,715,466,366	13,085.00	7,870,627,500	2.34
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	180,000	24,241.66	4,363,499,431	35,120.00	6,321,600,000	1.88
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,727,200	2,302.19	3,976,348,231	3,620.00	6,252,464,000	1.86
日本	株式	日立製作所	電気機器	412,700	10,329.08	4,262,812,518	14,620.00	6,033,674,000	1.80
日本	株式	キーエンス	電気機器	85,100	63,474.10	5,401,645,720	70,300.00	5,982,530,000	1.78
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	595,300	7,274.74	4,330,654,963	8,980.00	5,345,794,000	1.59
日本	株式	三井物産	卸売業	673,600	5,411.88	3,645,439,131	7,639.00	5,145,630,400	1.53
日本	株式	信越化学工業	化学	764,600	5,229.24	3,998,277,853	6,195.00	4,736,697,000	1.41
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	629,200	5,517.89	3,471,858,179	6,902.00	4,342,738,400	1.29
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	25,355,000	173.18	4,390,937,270	170.80	4,330,634,000	1.29
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	604,600	5,757.26	3,480,838,712	7,136.00	4,314,425,600	1.28
日本	株式	任天堂	その他製品	536,700	6,934.87	3,721,942,305	7,720.00	4,143,324,000	1.23
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	819,400	3,657.48	2,996,940,344	4,991.00	4,089,625,400	1.22
日本	株式	第一三共	医薬品	742,700	4,015.29	2,982,153,808	5,364.00	3,983,842,800	1.19
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	2,017,100	1,512.62	3,051,102,690	1,812.00	3,654,985,200	1.09
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,129,300	2,517.72	2,843,260,528	3,052.00	3,446,623,600	1.03
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	420,900	6,069.71	2,554,742,725	7,915.00	3,331,423,500	0.99
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	752,900	4,165.24	3,136,006,384	4,153.00	3,126,793,700	0.93
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	167,500	16,704.45	2,797,994,841	18,470.00	3,093,725,000	0.92
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	658,900	4,620.15	3,044,217,696	4,400.00	2,899,160,000	0.86
日本	株式	三菱電機	電気機器	955,700	2,016.12	1,926,810,170	2,773.00	2,650,156,100	0.79
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	1,911.00	2,602,399,800	0.77
日本	株式	住友商事	卸売業	543,400	3,110.57	1,690,285,323	4,155.00	2,257,827,000	0.67
日本	株式	村田製作所	電気機器	773,700	2,885.79	2,232,737,931	2,903.50	2,246,437,950	0.67
日本	株式	ダイキン工業	機械	102,600	22,145.86	2,272,165,208	21,745.00	2,231,037,000	0.66
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	509,200	3,803.83	1,936,910,532	4,245.00	2,161,554,000	0.64
日本	株式	ＳＭＣ	機械	25,700	74,670.18	1,919,023,666	83,520.00	2,146,464,000	0.64
日本	株式	三菱重工業	機械	1,502,100	833.84	1,252,515,015	1,417.50	2,129,226,750	0.63

ロ　種類別・業種別投資比率

2024年4月30日現在

種類	業種	投資比率（%）
株式（国内）	水産・農林業	0.08
	鉱業	0.34
	建設業	2.06
	食料品	3.10
	繊維製品	0.35
	パルプ・紙	0.15
	化学	5.51
	医薬品	4.27
	石油・石炭製品	0.51
	ゴム製品	0.71
	ガラス・土石製品	0.70
	鉄鋼	0.89
	非鉄金属	0.76
	金属製品	0.50
	機械	5.45
	電気機器	17.00
	輸送用機器	9.12
	精密機器	2.16
	その他製品	2.17
	電気・ガス業	1.44
	陸運業	2.37
	海運業	0.76
	空運業	0.38
	倉庫・運輸関連業	0.13
	情報・通信業	6.81
	卸売業	7.77
	小売業	4.07
	銀行業	7.44
	証券、商品先物取引業	0.90
	保険業	2.73
	その他金融業	1.13
	不動産業	2.09
	サービス業	4.27
合　計		98.12

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4月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	１５０５年国債	3,130,000,000	99.88	3,126,305,000	99.24	3,106,212,000	0.005	2026/12/20	2.34

日本	国債証券	１６５５年国債	1,510,000,000	99.71	1,505,656,200	99.32	1,499,701,800	0.300	2028/12/20	1.13
日本	国債証券	１４７５年国債	1,310,000,000	100.16	1,312,030,500	99.54	1,303,974,000	0.005	2026/03/20	0.98
日本	国債証券	１４９５年国債	1,290,000,000	100.09	1,291,134,100	99.34	1,281,421,500	0.005	2026/09/20	0.96
日本	国債証券	１５６５年国債	1,280,000,000	100.26	1,283,269,000	99.46	1,273,100,800	0.200	2027/12/20	0.96
日本	国債証券	１５４５年国債	1,220,000,000	100.13	1,221,595,800	99.21	1,210,386,400	0.100	2027/09/20	0.91
日本	国債証券	１５３５年国債	1,200,000,000	99.89	1,198,645,200	99.02	1,188,252,000	0.005	2027/06/20	0.89
日本	国債証券	１６０５年国債	1,190,000,000	99.89	1,188,711,300	99.23	1,180,789,400	0.200	2028/06/20	0.89
日本	国債証券	１４５５年国債	1,180,000,000	100.37	1,184,377,800	99.93	1,179,174,000	0.100	2025/09/20	0.89
日本	国債証券	１４８５年国債	1,180,000,000	100.12	1,181,409,400	99.42	1,173,097,000	0.005	2026/06/20	0.88
日本	国債証券	３６８１０年国債	1,190,000,000	96.98	1,154,102,100	95.66	1,138,342,100	0.200	2032/09/20	0.86
日本	国債証券	３６６１０年国債	1,170,000,000	96.45	1,128,408,200	96.23	1,125,855,900	0.200	2032/03/20	0.85
日本	国債証券	３６１１０年国債	1,160,000,000	98.28	1,139,991,900	96.96	1,124,759,200	0.100	2030/12/20	0.85
日本	国債証券	３６０１０年国債	1,150,000,000	98.52	1,132,952,200	97.19	1,117,708,000	0.100	2030/09/20	0.84
日本	国債証券	３５９１０年国債	1,130,000,000	98.78	1,116,257,000	97.42	1,100,789,500	0.100	2030/06/20	0.83
日本	国債証券	３６９１０年国債	1,110,000,000	100.92	1,120,223,100	97.89	1,086,601,200	0.500	2032/12/20	0.82
日本	国債証券	３６２１０年国債	1,120,000,000	98.32	1,101,133,200	96.69	1,082,972,800	0.100	2031/03/20	0.82
日本	国債証券	３７３１０年国債	1,100,000,000	98.93	1,088,241,700	97.73	1,075,019,000	0.600	2033/12/20	0.81
日本	国債証券	３６７１０年国債	1,110,000,000	98.47	1,093,012,700	95.93	1,064,811,900	0.200	2032/06/20	0.80
日本	国債証券	３７０１０年国債	1,070,000,000	100.51	1,075,461,600	97.67	1,045,101,100	0.500	2033/03/20	0.79
日本	国債証券	４５５２年国債	1,030,000,000	99.94	1,029,344,900	99.68	1,026,652,500	0.005	2025/12/01	0.77
日本	国債証券	１４６５年国債	1,000,000,000	100.40	1,003,980,000	99.82	998,200,000	0.100	2025/12/20	0.75

日本	国債証券	３６５ １０年国債	1,040,000,000	97.98	1,018,940,600	95.75	995,831,200	0.100	2031/12/20	0.75
日本	国債証券	３６３ １０年国債	1,030,000,000	98.04	1,009,814,000	96.38	992,714,000	0.100	2031/06/20	0.75
日本	国債証券	３５８ １０年国債	1,010,000,000	99.00	999,889,000	97.63	986,052,900	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	96.51	974,761,100	0.400	2033/06/20	0.73
日本	国債証券	１５８ ５年国債	980,000,000	100.09	980,925,200	98.97	969,857,000	0.100	2028/03/20	0.73
日本	国債証券	３７２ １０年国債	970,000,000	101.40	983,591,900	99.83	968,302,500	0.800	2033/09/20	0.73
日本	国債証券	３６４ １０年国債	980,000,000	97.58	956,329,200	96.05	941,329,200	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	106.97	898,522,800	1.600	2033/12/20	0.68

ロ　種類別投資比率

2024年4月30日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	80.12
地方債証券	6.45
特殊債券	7.77
社債券	5.29
合　計	99.64

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4月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	575,981	59,715.50	34,394,994,335	63,113.03	36,351,903,252	4.72
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	1,198,377	29,605.92	35,479,054,109	27,222.15	32,622,398,450	4.23

アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	201,548	78,161.11	15,753,216,365	137,690.73	27,751,291,854	3.60
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	759,044	23,226.87	17,630,214,861	28,392.62	21,551,250,891	2.80
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	483,383	21,293.84	10,293,081,590	26,068.94	12,601,280,007	1.64
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	181,252	53,523.06	9,701,162,286	67,878.08	12,303,037,393	1.60
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	420,965	21,514.20	9,056,725,849	26,343.51	11,089,695,687	1.44
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	36,374	150,827.19	5,486,188,216	210,029.48	7,639,612,232	0.99
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	65,979	94,392.83	6,227,944,842	115,666.68	7,631,571,879	0.99
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	236,445	24,515.43	5,796,549,671	30,325.63	7,170,344,058	0.93
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	234,252	37,592.69	8,806,163,850	30,446.45	7,132,140,634	0.93
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	107,214	56,753.80	6,084,801,766	62,910.62	6,744,899,641	0.88
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	327,023	16,125.33	5,273,355,089	18,771.52	6,138,717,476	0.80
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	75,414	83,658.49	6,309,021,726	76,728.81	5,786,426,251	0.75
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	129,093	40,053.24	5,170,593,506	42,651.70	5,506,035,391	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	266,800	15,774.37	4,208,601,521	19,952.24	5,323,257,632	0.69
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	68,582	64,752.03	4,440,823,554	71,718.99	4,918,631,772	0.64
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	192,252	23,786.02	4,572,909,290	25,364.45	4,876,367,010	0.63
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	32,866	107,844.82	3,544,427,792	142,515.32	4,683,908,638	0.61
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	197,212	23,929.34	4,719,153,623	23,036.06	4,542,987,070	0.59
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	81,562	49,211.19	4,013,762,814	52,843.92	4,310,055,803	0.56
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	207,712	16,160.32	3,356,693,287	20,415.83	4,240,612,465	0.55
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	36,375	93,917.63	3,416,253,906	113,961.18	4,145,337,813	0.54
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	146,001	22,668.34	3,309,601,037	26,097.18	3,810,213,939	0.49

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	144,787	22,137.43	3,205,212,690	25,342.49	3,669,262,810	0.48
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	218,570	17,034.43	3,723,214,759	15,853.41	3,465,080,610	0.45
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	584,437	4,813.98	2,813,467,779	5,891.60	3,443,266,107	0.45
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	362,153	8,224.26	2,978,439,823	9,451.66	3,422,945,575	0.44
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	78,917	36,689.94	2,895,460,272	43,263.61	3,414,233,994	0.44
アメリカ	株式	ADVANCED MICRO DEVICES	半導体・半導体製造装置	132,665	19,906.04	2,640,834,352	25,135.38	3,334,585,187	0.43

ロ　種類別・業種別投資比率

2024年4月30日現在

種類	業種	投資比率（%）
株式（外国）	エネルギー	4.89
	素材	3.87
	資本財	7.17
	商業・専門サービス	1.57
	運輸	1.62
	自動車・自動車部品	1.73
	耐久消費財・アパレル	1.45
	消費者サービス	1.99
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.87
	生活必需品流通・小売り	1.71
	食品・飲料・タバコ	3.29
	家庭用品・パーソナル用品	1.61
	ヘルスケア機器・サービス	4.18
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.78
	銀行	5.58
	金融サービス	6.62
	保険	3.01
	ソフトウェア・サービス	9.73
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.67

	半導体・半導体製造装置	8.24
	電気通信サービス	1.09
	公益事業	2.57
	メディア・娯楽	6.42
	不動産管理・開発	0.30
投資証券	―	1.88
合　計		98.83

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4月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,450,000	14,750.95	1,688,984,175	14,679.88	1,680,846,008	1.625	2026/05/15	0.90
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	65,000,000	2,174.74	1,413,579,806	2,187.63	1,421,957,558	2.390	2026/11/15	0.76
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,200,000	14,997.91	1,229,828,956	14,914.60	1,222,997,216	2.250	2026/03/31	0.65
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	50,000,000	2,178.84	1,089,422,027	2,200.87	1,100,433,173	2.690	2026/08/12	0.59
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	38,700,000	2,469.11	955,547,236	2,624.61	1,015,724,686	3.720	2051/04/12	0.54
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	43,000,000	2,225.79	957,088,602	2,275.65	978,530,051	3.020	2031/05/27	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,200,000	13,738.48	989,170,401	13,528.86	974,077,876	0.625	2027/12/31	0.52
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	41,000,000	2,155.96	883,942,143	2,188.77	897,397,158	2.400	2028/07/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	15,628.89	937,733,247	14,803.67	888,220,314	3.875	2033/08/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,100,000	15,176.31	925,754,873	14,417.54	879,470,001	3.500	2033/02/15	0.47
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	39,000,000	2,155.05	840,468,667	2,174.63	848,103,999	2.180	2025/08/25	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,600,000	15,912.33	891,090,328	15,133.48	847,474,639	4.125	2032/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	15,530.59	823,121,248	15,389.07	815,620,487	3.875	2026/01/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,900,000	13,773.78	812,653,037	13,556.16	799,813,440	0.750	2028/01/31	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	14,504.62	826,763,368	13,850.03	789,451,920	2.875	2032/05/15	0.42

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	15,020.66	826,136,553	14,249.66	783,731,190	3.375	2033/05/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	14,943.16	791,987,268	14,612.10	774,441,141	2.750	2028/02/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	15,694.24	784,711,815	15,285.67	764,283,435	4.000	2028/02/29	0.41
フランス	国債証券	FRANCE OAT.	4,600,000	16,741.46	770,106,947	16,611.60	764,133,644	2.500	2026/09/24	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,900,000	15,658.67	767,274,611	15,354.70	752,380,530	4.000	2027/01/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	15,832.79	759,974,019	15,595.55	748,586,217	4.625	2026/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	13,040.74	743,322,379	12,554.35	715,598,149	1.125	2031/02/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	13,410.56	737,580,624	12,899.06	709,448,454	1.625	2031/05/15	0.38
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	32,000,000	2,164.13	692,522,778	2,208.09	706,589,355	2.600	2030/09/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	14,967.95	718,461,417	14,719.10	706,516,934	2.625	2027/05/31	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	14,514.66	725,733,105	14,119.74	705,987,240	2.375	2029/03/31	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,500,000	16,433.71	739,517,058	15,539.22	699,264,859	4.500	2033/11/15	0.37
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	31,500,000	2,176.98	685,749,842	2,208.09	695,548,896	2.640	2028/01/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,500,000	15,267.00	687,014,892	15,313.60	689,111,860	2.625	2025/04/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	13,452.92	713,004,749	12,884.47	682,876,968	1.875	2032/02/15	0.36

ロ　種類別投資比率

2024年4月30日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	98.62
合　計	98.62

マネーインカム・マザーファンド

イ　主要投資銘柄

2024年4月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	特殊債券	２２０　政保道路機構	200,000,000	100.22	200,449,200	100.17	200,337,200	0.644	2024/06/28	10.28
日本	国債証券	１２２６国庫短期証券	200,000,000	99.87	199,741,600	99.87	199,747,400	0.000	2025/04/21	10.24
日本	国債証券	３３７　１０年国債	150,000,000	100.17	150,253,500	100.15	150,229,500	0.300	2024/12/20	7.71

日本	国債証券	３３５　１０年国債	120,000,000	100.21	120,249,600	100.18	120,220,800	0.500	2024/09/20	6.17
日本	特殊債券	２２２　政保道路機構	100,000,000	100.25	100,250,600	100.20	100,204,400	0.601	2024/07/31	5.14
日本	特殊債券	２２５　政保道路機構	100,000,000	100.23	100,233,800	100.20	100,198,600	0.556	2024/08/30	5.14
日本	特殊債券	６４政保地方公共団	100,000,000	100.21	100,211,200	100.18	100,181,500	0.544	2024/09/13	5.14
日本	特殊債券	３１　政保日本政策	100,000,000	100.21	100,211,200	100.18	100,181,500	0.544	2024/09/13	5.14
日本	特殊債券	２１８　政保道路機構	100,000,000	100.15	100,149,500	100.09	100,092,700	0.660	2024/05/31	5.13
日本	特殊債券	６０政保地方公共団	100,000,000	100.11	100,113,600	100.07	100,066,400	0.660	2024/05/21	5.13

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ　種類別投資比率

2024年4月30日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	24.12
特殊債券	41.10
合　計	65.21

②投資不動産物件

国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）

該当事項はありません。

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

マネーインカム・マザーファンド

該当事項はありません。

③その他投資資産の主要なもの

国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）

2024年4月30日現在

種類	国／地域	取引所等	名称	買建／売建	数量	通貨	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	日本	大阪取引所	ＴＯＰＩＸ　　先物　０６０６月　２０２４年６月	買建	232	日本・円	6,358,015,200	6,373,040,000	1.90

（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。

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

2024年4月30日現在

種類	国／地域	取引所等	名称	買建／売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価(円)	評価額	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	イギリス	ＩＣＥ－ＥＵ	ＦＴＳＥ　１００　ＩＤＸ　ＦＵＴ　ＪＵＮ２４ 2024年6月	買建	26	イギリス・ポンド	2,077,677.00	409,343,922	2,122,510.00	418,176,920	0.05
	ドイツ	ＥＵＲＥＸ	ＥＵＲＯ　ＳＴＯＸＸ　５０　ＪＵＮ２４ 2024年6月	買建	173	ユーロ	8,611,776.00	1,447,811,781	8,577,340.00	1,442,022,400	0.19
	アメリカ	シカゴ商品取引所	Ｓ＆Ｐ５００ ＥＭＩＮＩ　ＦＵＴ　ＪＵＮ２４ 2024年6月	買建	196	アメリカ・ドル	51,201,925.50	8,033,582,110	50,440,600.00	7,914,130,140	1.03
	オーストラリア	シドニー先物取引所	ＳＰＩ２００ ＦＵＴＵＲＥＳ ＪＵＮ２４ 2024年6月	買建	13	オーストラリア・ドル	2,560,883.50	263,668,565	2,489,175.00	256,285,458	0.03

（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4月30日現在

種類	資産の名称	買建／売建	数量	簿価(円)	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引	アメリカ・ドル	買建	7,653,000.00	1,197,149,563	1,199,711,052	0.16
	オーストラリア・ドル	買建	607,000.00	62,434,259	62,441,483	0.01
	ユーロ	買建	332,000.00	55,766,040	55,770,920	0.01
	カナダ・ドル	買建	456,000.00	51,738,763	52,326,592	0.01
	イギリス・ポンド	買建	247,000.00	48,609,575	48,613,230	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。

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。

マネーインカム・マザーファンド

該当事項はありません。

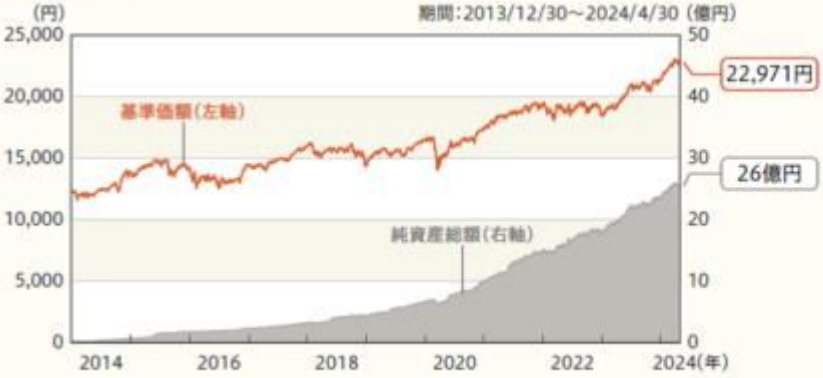
≪参考情報≫

基準日:2024年4月30日

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

基準価額・純資産の推移

<2040>



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

分配の推移

決算期	分配金
2024年4月	0円
2023年4月	0円
2022年4月	0円
2021年4月	0円
2020年4月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。
※直近5計算期間を記載しています。

主要な資産の状況

<2040>

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	99.35
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.65
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	36.41
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)	24.72
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	20.13
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	16.28
日本	親投資信託受益証券	マネーインカム・マザーファンド	1.80

※比率は、ファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。
※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

■国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	日本	98.12
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.88
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て　1.90%

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	5.06
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.40
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2.34
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	1.88
日本	株式	三菱商事	卸売業	1.86
日本	株式	日立製作所	電気機器	1.80
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.78
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.59
日本	株式	三井物産	卸売業	1.53
日本	株式	信越化学工業	化学	1.41

■国内債券パッシブ・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	日本	80.12
特殊債券	日本	7.77
地方債証券	日本	6.45
社債券	日本	5.29
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.37
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	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	国債証券	150　5年国債	0.005	2026/12/20	2.34
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	0.96
日本	国債証券	154　5年国債	0.100	2027/09/20	0.91
日本	国債証券	153　5年国債	0.005	2027/06/20	0.89
日本	国債証券	160　5年国債	0.200	2028/06/20	0.89
日本	国債証券	145　5年国債	0.100	2025/09/20	0.89
日本	国債証券	148　5年国債	0.005	2026/06/20	0.88

■外国株式インデックス・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	アメリカ	70.40
	イギリス	3.81
	カナダ	3.31
	フランス	3.03
	スイス	2.87
	ドイツ	2.35
	その他	11.19
投資証券	アメリカ・その他	1.88
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.17
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て　1.30%

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4.72
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	4.23
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	3.60
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	2.80
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	1.64
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	1.60
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1.44
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	0.99
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.99
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	0.93

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

■外国債券パッシブ・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	アメリカ	46.31
	中国	9.17
	フランス	7.83
	イタリア	7.16
	ドイツ	6.18
	イギリス	5.02
	スペイン	4.81
	その他	12.14
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.38
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	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	0.90
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.390	2026/11/15	0.76
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2026/03/31	0.65
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.690	2026/08/12	0.59
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	3.720	2051/04/12	0.54
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	3.020	2031/05/27	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.625	2027/12/31	0.52
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.400	2028/07/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.875	2033/08/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.500	2033/02/15	0.47

■マネーインカム・マザーファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
特殊債券	日本	41.10
国債証券	日本	24.12
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		34.78
合計(純資産総額)		100.00

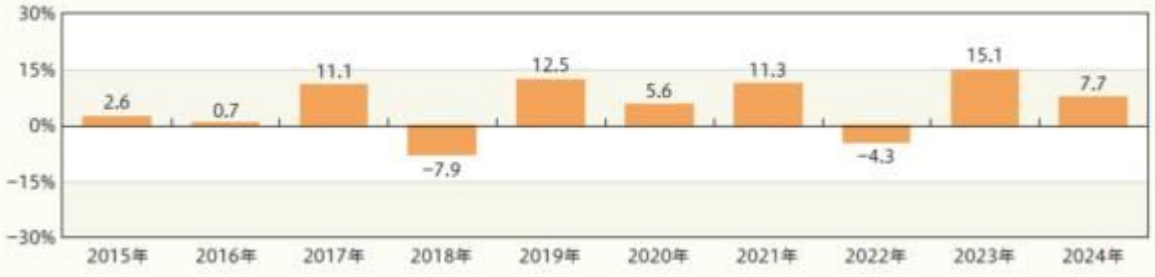
主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	特殊債券	220　政保道路機構	0.644	2024/06/28	10.28
日本	国債証券	1226国庫短期証券	0.000	2025/04/21	10.24
日本	国債証券	337　10年国債	0.300	2024/12/20	7.71
日本	国債証券	335　10年国債	0.500	2024/09/20	6.17
日本	特殊債券	222　政保道路機構	0.601	2024/07/31	5.14
日本	特殊債券	225　政保道路機構	0.556	2024/08/30	5.14
日本	特殊債券	64政保地方公共団	0.544	2024/09/13	5.14
日本	特殊債券	31　政保日本政策	0.544	2024/09/13	5.14
日本	特殊債券	218　政保道路機構	0.660	2024/05/31	5.13
日本	特殊債券	60政保地方公共団	0.660	2024/05/21	5.13

※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)

■<2040>



※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。
※2024年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。
※ファンドにはベンチマークはありません。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

イ　申込方法

（イ）ファンドの取得申込者は、お申込みを取り扱う販売会社に取引口座を開設の上、当ファンドの取得申込みを行っていただきます。
当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」の２つの申込方法がありますが、販売会社によってはいずれか一方のみの取扱いとなる場合があります。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、取得申込みの受付けを中止させていただく場合、既に受け付けた取得申込みを取り消させていただく場合があります。

（ハ）当ファンドの取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。
販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。
ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

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

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

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。
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５営業日目からお支払いします。
一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。
解約単位の詳細および一部解約価額につきましては、お申込みの販売会社にお問い合わせください。
委託会社は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付けを中止すること、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。

ロ　基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。
基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「ＤＣ2040」として掲載されます。
委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	コールセンター※	ホームページ

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

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

（２）【保管】

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

（３）【信託期間】

2008年３月31日から下記「（５）その他 イ　信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

（４）【計算期間】

毎年４月14日から翌年４月13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１億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

ｂ．委託会社は、上記ａの事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の２週間前までに、当ファンドの知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

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、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

ｄ．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。

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、受託会社がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。

ｂ．上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。

ｃ．委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。

ロ　収益分配金、償還金の支払い

（イ）収益分配金

ａ．分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

ハ　信託約款の変更等

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

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

（ハ）上記（ロ）の書面決議において、受益者（委託会社等を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使

しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

（ホ）上記（ロ）から（ニ）までの取扱いは、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

（ヘ）上記にかかわらず、当ファンドと他のファンドとの併合の場合は、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、相手方となる他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、併合を行うことはできません。

ニ　反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

ホ　販売会社との契約の更改等

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

ヘ　委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

ト　公告

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

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

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

チ　運用にかかる報告書の開示方法

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

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ　分配金請求権

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

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

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

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

ロ　償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

ハ　一部解約実行請求権

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

ニ　書面決議における議決権

委託会社が、当ファンドの解約（監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。）または、重大な信託約款の変更等を行おうとする場合において、受益者は、それぞれの書面決議手続きにおいて、受益権の口数に応じて議決権を有しこれを行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16期（2023年4月14日から2024年4月15日まで）の財務諸表について、PwC Japan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ターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第15期 （2023年 4月13日現在）	第16期 （2024年 4月15日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	659,259	389,270
コール・ローン	14,769,049	18,390,815
親投資信託受益証券	1,976,986,137	2,550,119,259
未収入金	-	3,200,000
流動資産合計	1,992,414,445	2,572,099,344
資産合計	1,992,414,445	2,572,099,344
負債の部		
流動負債		
未払解約金	446,864	3,394,830
未払受託者報酬	306,527	403,443
未払委託者報酬	3,985,334	5,245,351
その他未払費用	51,054	67,182
流動負債合計	4,789,779	9,110,806
負債合計	4,789,779	9,110,806
純資産の部		
元本等		
元本	1,022,545,496	1,122,330,377
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	965,079,170	1,440,658,161
（分配準備積立金）	230,141,615	557,081,734
元本等合計	1,987,624,666	2,562,988,538
純資産合計	1,987,624,666	2,562,988,538
負債純資産合計	1,992,414,445	2,572,099,344

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第15期 自　2022年 4月14日 至　2023年 4月13日	第16期 自　2023年 4月14日 至　2024年 4月15日
営業収益		
受取利息	108	1,027
有価証券売買等損益	50,763,577	379,746,122
営業収益合計	50,763,685	379,747,149
営業費用		
支払利息	4,958	6,260
受託者報酬	585,023	761,185
委託者報酬	7,606,226	9,896,525
その他費用	97,698	127,073
営業費用合計	8,293,905	10,791,043
営業利益又は営業損失（△）	42,469,780	368,956,106
経常利益又は経常損失（△）	42,469,780	368,956,106
当期純利益又は当期純損失（△）	42,469,780	368,956,106
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（△）	457,397	20,235,501
期首剰余金又は期首欠損金（△）	737,358,225	965,079,170
剰余金増加額又は欠損金減少額	240,770,712	230,570,991
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	240,770,712	230,570,991
剰余金減少額又は欠損金増加額	55,062,150	103,712,605
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	55,062,150	103,712,605
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（△）	965,079,170	1,440,658,161

（３）【注記表】

（重要な会計方針の注記）

項　目	第16期 自 2023年4月14日 至 2024年4月15日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	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。 (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。 (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。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 　直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
２．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	計算期間の取扱い 　当計算期間は当期末が休日のため、2023年4月14日から2024年4月15日までとなっております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項　目	第15期 （2023年4月13日現在）	第16期 （2024年4月15日現在）
１．　当計算期間の末日における受益権の総数	1,022,545,496口	1,122,330,377口
２．　１単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　1.9438円 （１万口当たりの純資産額19,438円）	1口当たり純資産額　2.2836円 （１万口当たりの純資産額22,836円）

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項　目	第15期 自 2022年4月14日 至 2023年4月13日	第16期 自 2023年4月14日 至 2024年4月15日

分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（27,261,747円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（14,750,636円）、収益調整金（751,675,494円）、および分配準備積立金（188,129,232円）より、分配対象収益は981,817,109円（１万口当たり9,601.70円）でありますが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（38,553,452円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（310,167,153円）、収益調整金（883,576,427円）、および分配準備積立金（208,361,129円）より、分配対象収益は1,440,658,161円（１万口当たり12,836.31円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	第16期 自 2023年4月14日 至 2024年4月15日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

３． 金融商品に係るリスク管理体制	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。 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、上下限値、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。 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。

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	第16期 （2024年4月15日現在）
１． 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２． 時価の算定方法	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
３． 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第15期（自 2022年4月14日　至 2023年4月13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	48,844,564円
合計	48,844,564円

第16期（自 2023年4月14日　至 2024年4月15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	352,829,075円
合計	352,829,075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16期 自 2023年4月14日 至 2024年4月15日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

項　目	第15期 （2023年4月13日現在）	第16期 （2024年4月15日現在）
期首元本額	815,583,734円	1,022,545,496円
期中追加設定元本額	267,928,064円	208,134,656円
期中一部解約元本額	60,966,302円	108,349,775円

（４）【附属明細表】

①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）	141,209,819	692,168,169	
	外国株式インデックス・マザーファンド	50,605,421	442,083,897	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	222,554,062	503,083,457	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	723,109,470	868,309,851	
	マネーインカム・マザーファンド	44,151,579	44,473,885	
	親投資信託受益証券　小計		2,550,119,259	
合　計			2,550,119,259	

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ）は、「国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」および「マネーインカム・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。
なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）

（１）貸借対照表

（単位：円）

	（2024年4月15日現在）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	77,400,429
コール・ローン	3,656,735,818
株式	328,904,326,020
派生商品評価勘定	70,619,000
未収入金	81,000,000
未収配当金	3,192,555,428
差入委託証拠金	315,144,027
流動資産合計	336,297,780,722
資産合計	336,297,780,722
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	25,424,500
前受金	56,910,000
未払解約金	194,666,862
流動負債合計	277,001,362
負債合計	277,001,362
純資産の部	
元本等	
元本	68,551,975,215
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	267,468,804,145
元本等合計	336,020,779,360
純資産合計	336,020,779,360
負債純資産合計	336,297,780,722

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2023年4月14日 至 2024年4月15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。 (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。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
２．　デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。

（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	（2024年4月15日現在）
１．　当計算期間の末日における受益権の総数	68,551,975,215口
２．　１単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　4.9017円 （１万口当たりの純資産額49,017円）

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	自 2023年4月14日 至 2024年4月15日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、先物取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等

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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	（2024年4月15日現在）
１． 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２． 時価の算定方法	(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
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）

（2024年4月15日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区　分	種　類	契　約　額　等		時　価	評価損益
			うち１年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建				
	TOPIX 先物 0606月	7,026,160,500	-	7,071,355,000	45,194,500
	小計	7,026,160,500	-	7,071,355,000	45,194,500
合　計		7,026,160,500	-	7,071,355,000	45,194,500

（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 2023年4月14日 至 2024年4月15日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

（2024年4月15日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	66,834,421,601円
同期中における追加設定元本額	12,136,975,450円
同期中における一部解約元本額	10,419,421,836円
2024年4月15日現在の元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,573,062,617円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	921,481,018円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	4,196,495,748円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	3,560,527,035円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	125,188,754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）	3,136,362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）	13,072,720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）	50,158,318円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５（４資産タイプ）	145,491,564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）	141,209,819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）	261,301,201円

国内株式指数ファンド（ＴＯＰＩＸ）	1,341,284,565円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・日本株インデックスファンド	27,754,418,583円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	210,649,656円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	290,619,561円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	164,964,349円
イオン・バランス戦略ファンド	62,614,855円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	55,716,088円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	194,941,320円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	198,285,293円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	791,637,244円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	473,702,327円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	572,413,594円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	56,403,527円
三井住友ＤＳ・国内株式インデックス年金ファンド	1,296,749,756円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	40,690,489円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	237,073,693円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	265,732,170円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	5,633,091円
日興ＦＷＳ・日本株インデックス	2,371,556,314円
三井住友ＤＳ・ＴＯＰＩＸインデックス・ファンド	152,171,100円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５	7,304,988円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０	4,236,166円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５	5,927,872円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５	2,044,427円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５	1,129,725円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型）	477,537円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型）	11,995,860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）	60,990,124円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型）	43,593,309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）	17,953,998円
ＳＭＡＭ・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	2,030,848,272円
バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	8,182,607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＞	35,979,393円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	773,096,335円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	1,026,950,797円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	4,048,767,420円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	26,136,229円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	96,405,729円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	567,812,241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＞	30,970,130円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	164,378,994円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	569,161,016円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	379,912,816円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	1,087,866,423円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	24,835,775円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	26,064,359円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	22,932,741円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	13,084,116円

ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	58,123,539円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	150,361,295円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	31,493,207円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	28,439,533円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	6,584,711円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３０Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	27,603,219円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	353,787,061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）	149,449,348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＞	133,319,324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＞	56,504,391円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	38,414,398円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	24,784,224円
ＳＭＡＭ・年金Ｗリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	41,265,252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＞	20,403,150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＞	32,596,587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Ⅱ＜適格機関投資家限定＞	680,510,322円
ＳＭＤＡＭ・日米３資産バランスオープン＜適格機関投資家限定＞	10,385,808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＞	90,527,716円
合　計	68,551,975,215円

（３）附属明細表

①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	3,680.000	15,088,000	
ニッスイ	119,400	955.000	114,027,000	
マルハニチロ	17,700	3,104.000	54,940,800	
雪国まいたけ	11,400	996.000	11,354,400	
カネコ種苗	4,800	1,426.000	6,844,800	
サカタのタネ	13,400	3,605.000	48,307,000	
ホクト	10,100	1,829.000	18,472,900	
住石ホールディングス	13,800	1,112.000	15,345,600	
日鉄鉱業	4,600	5,130.000	23,598,000	
三井松島ホールディングス	7,100	3,115.000	22,116,500	
ＩＮＰＥＸ	399,900	2,587.500	1,034,741,250	
石油資源開発	13,400	7,290.000	97,686,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	5,500	3,445.000	18,947,500	
ショーボンドホールディングス	15,900	6,025.000	95,797,500	
ミライト・ワン	39,000	1,975.000	77,025,000	
タマホーム	7,600	4,185.000	31,806,000	
日本アクア	3,300	1,012.000	3,339,600	
安藤・間	66,700	1,198.000	79,906,600	

東急建設	34,200	826.000	28,249,200		
コムシスホールディングス	37,600	3,621.000	136,149,600		
ビーアールホールディングス	18,500	372.000	6,882,000		
高松コンストラクショングループ	8,200	2,653.000	21,754,600		
東建コーポレーション	3,200	10,850.000	34,720,000		
ヤマウラ	6,300	1,399.000	8,813,700		
オリエンタル白石	44,000	383.000	16,852,000		
大成建設	77,700	5,469.000	424,941,300		
大林組	296,200	1,734.500	513,758,900		
清水建設	236,400	884.400	209,072,160		
飛島建設	9,400	1,388.000	13,047,200		
長谷工コーポレーション	78,700	1,883.500	148,231,450		
松井建設	9,700	902.000	8,749,400		
錢高組	1,500	4,130.000	6,195,000		
鹿島建設	183,500	3,037.000	557,289,500		
不動テトラ	5,600	2,107.000	11,799,200		
鉄建建設	6,700	2,775.000	18,592,500		
西松建設	15,900	4,586.000	72,917,400		
三井住友建設	65,600	413.000	27,092,800		
大豊建設	3,800	3,260.000	12,388,000		
奥村組	12,900	4,875.000	62,887,500		
東鉄工業	10,900	3,145.000	34,280,500		
淺沼組	6,200	3,765.000	23,343,000		
戸田建設	112,800	1,008.000	113,702,400		
熊谷組	13,400	4,250.000	56,950,000		
北野建設	1,900	3,415.000	6,488,500		
矢作建設工業	11,500	1,453.000	16,709,500		
ピーエス三菱	10,900	1,017.000	11,085,300		
日本ハウスホールディングス	19,500	333.000	6,493,500		
新日本建設	11,500	1,615.000	18,572,500		
東亜道路工業	17,000	1,286.000	21,862,000		
日本道路	9,300	1,889.000	17,567,700		
東亜建設工業	26,800	1,131.000	30,310,800		
日本国土開発	24,300	527.000	12,806,100		
若築建設	3,200	3,625.000	11,600,000		
東洋建設	22,400	1,256.000	28,134,400		
五洋建設	117,600	781.100	91,857,360		
世紀東急工業	10,800	1,818.000	19,634,400		
福田組	3,100	5,450.000	16,895,000		
住友林業	71,600	4,802.000	343,823,200		
巴コーポレーション	11,300	694.000	7,842,200		
大和ハウス工業	228,700	4,373.000	1,000,105,100		
ライト工業	15,400	2,077.000	31,985,800		
積水ハウス	250,300	3,547.000	887,814,100		
日特建設	6,800	1,158.000	7,874,400		
北陸電気工事	4,700	1,244.000	5,846,800		
ユアテック	17,800	1,497.000	26,646,600		
日本リーテック	7,700	1,322.000	10,179,400		

四電工	3,500	3,970.000	13,895,000		
中電工	11,500	3,445.000	39,617,500		
関電工	50,500	1,890.000	95,445,000		
きんでん	58,200	3,063.000	178,266,600		
東京エネシス	8,700	1,390.000	12,093,000		
トーエネック	2,900	5,720.000	16,588,000		
住友電設	7,400	3,680.000	27,232,000		
日本電設工業	14,700	2,190.000	32,193,000		
エクシオグループ	80,000	1,672.000	133,760,000		
新日本空調	5,300	3,920.000	20,776,000		
九電工	18,500	7,021.000	129,888,500		
三機工業	16,900	2,245.000	37,940,500		
日揮ホールディングス	82,900	1,574.500	130,526,050		
中外炉工業	3,000	2,930.000	8,790,000		
ヤマト	7,000	1,004.000	7,028,000		
太平電業	5,000	4,490.000	22,450,000		
高砂熱学工業	21,700	5,210.000	113,057,000		
三晃金属工業	1,200	4,850.000	5,820,000		
朝日工業社	8,000	1,676.000	13,408,000		
明星工業	16,000	1,263.000	20,208,000		
大氣社	9,200	4,570.000	42,044,000		
ダイダン	10,600	2,864.000	30,358,400		
日比谷総合設備	6,400	2,903.000	18,579,200		
テスホールディングス	19,300	456.000	8,800,800		
インフロニア・ホールディングス	95,800	1,412.000	135,269,600		
東洋エンジニアリング	12,300	1,001.000	12,312,300		
レイズネクスト	11,600	2,060.000	23,896,000		
ニップン	23,300	2,443.000	56,921,900		
日清製粉グループ本社	77,600	2,091.000	162,261,600		
日東富士製粉	1,700	5,170.000	8,789,000		
昭和産業	6,800	3,480.000	23,664,000		
鳥越製粉	10,700	688.000	7,361,600		
中部飼料	11,300	1,143.000	12,915,900		
フィード・ワン	12,900	1,021.000	13,170,900		
日本甜菜製糖	5,200	2,012.000	10,462,400		
ＤＭ三井製糖ホールディングス	7,900	3,035.000	23,976,500		
ウェルネオシュガー	4,700	2,216.000	10,415,200		
森永製菓	35,500	2,578.000	91,519,000		
中村屋	3,100	3,130.000	9,703,000		
江崎グリコ	23,900	4,256.000	101,718,400		
井村屋グループ	4,600	2,450.000	11,270,000		
不二家	5,700	2,493.000	14,210,100		
山崎製パン	56,000	3,821.000	213,976,000		
モロゾフ	2,600	4,025.000	10,465,000		
亀田製菓	5,100	4,160.000	21,216,000		
寿スピリッツ	40,500	1,684.500	68,222,250		
カルビー	38,300	3,587.000	137,382,100		
森永乳業	29,600	3,076.000	91,049,600		

六甲バター	6,300	1,464.000	9,223,200		
ヤクルト本社	119,300	2,958.000	352,889,400		
明治ホールディングス	102,200	3,370.000	344,414,000		
雪印メグミルク	19,700	2,650.000	52,205,000		
プリマハム	10,600	2,265.000	24,009,000		
日本ハム	35,900	5,153.000	184,992,700		
丸大食品	8,400	1,647.000	13,834,800		
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	8,900	3,410.000	30,349,000		
柿安本店	3,000	3,180.000	9,540,000		
伊藤ハム米久ホールディングス	12,100	4,140.000	50,094,000		
サッポロホールディングス	27,600	5,925.000	163,530,000		
アサヒグループホールディングス	192,000	5,468.000	1,049,856,000		
キリンホールディングス	345,600	2,219.000	766,886,400		
宝ホールディングス	57,100	1,021.000	58,299,100		
オエノンホールディングス	26,200	352.000	9,222,400		
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	65,900	2,275.000	149,922,500		
ライフドリンク　カンパニー	1,400	5,100.000	7,140,000		
サントリー食品インターナショナル	58,600	5,174.000	303,196,400		
ダイドーグループホールディングス	9,000	2,678.000	24,102,000		
伊藤園	28,600	3,763.000	107,621,800		
キーコーヒー	8,400	2,006.000	16,850,400		
日清オイリオグループ	11,300	5,100.000	57,630,000		
不二製油グループ本社	19,900	2,373.000	47,222,700		
かどや製油	1,800	3,660.000	6,588,000		
Ｊ－オイルミルズ	8,300	1,992.000	16,533,600		
キッコーマン	276,000	1,909.500	527,022,000		
味の素	197,500	5,552.000	1,096,520,000		
ブルドックソース	4,700	2,048.000	9,625,600		
キユーピー	44,700	3,129.000	139,866,300		
ハウス食品グループ本社	28,500	3,067.000	87,409,500		
カゴメ	36,400	3,729.000	135,735,600		
アリアケジャパン	8,200	5,130.000	42,066,000		
エバラ食品工業	2,800	2,874.000	8,047,200		
やまみ	900	3,600.000	3,240,000		
ニチレイ	38,300	4,091.000	156,685,300		
東洋水産	42,100	9,668.000	407,022,800		
イートアンドホールディングス	4,100	1,986.000	8,142,600		
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,000	1,232.000	6,160,000		
日清食品ホールディングス	87,800	4,101.000	360,067,800		
永谷園ホールディングス	4,200	2,268.000	9,525,600		
フジッコ	7,600	1,910.000	14,516,000		
ロック・フィールド	9,100	1,639.000	14,914,900		
日本たばこ産業	504,900	4,180.000	2,110,482,000		
ケンコーマヨネーズ	6,300	2,295.000	14,458,500		
わらべや日洋ホールディングス	6,200	2,402.000	14,892,400		
なとり	4,600	2,109.000	9,701,400		
ファーマフーズ	12,200	815.000	9,943,000		

ユーグレナ	52,500	529.000	27,772,500		
紀文食品	7,100	1,148.000	8,150,800		
ピックルスホールディングス	5,200	1,190.000	6,188,000		
ミヨシ油脂	5,200	1,261.000	6,557,200		
理研ビタミン	7,200	2,750.000	19,800,000		
片倉工業	9,000	1,958.000	17,622,000		
グンゼ	5,900	5,330.000	31,447,000		
東洋紡	36,100	1,162.000	41,948,200		
ユニチカ	30,500	208.000	6,344,000		
富士紡ホールディングス	3,500	4,175.000	14,612,500		
倉敷紡績	6,600	3,475.000	22,935,000		
シキボウ	5,700	1,081.000	6,161,700		
日本毛織	21,800	1,373.000	29,931,400		
ダイドーリミテッド	8,100	552.000	4,471,200		
帝国繊維	9,300	2,295.000	21,343,500		
帝人	82,100	1,512.500	124,176,250		
東レ	568,200	737.000	418,763,400		
ダイニック	3,300	741.000	2,445,300		
セーレン	16,000	2,732.000	43,712,000		
小松マテーレ	13,300	763.000	10,147,900		
ワコールホールディングス	17,500	3,466.000	60,655,000		
ホギメディカル	11,200	3,600.000	40,320,000		
ＴＳＩホールディングス	28,800	923.000	26,582,400		
ワールド	11,800	2,094.000	24,709,200		
三陽商会	3,500	2,864.000	10,024,000		
オンワードホールディングス	54,600	644.000	35,162,400		
ルックホールディングス	3,700	2,966.000	10,974,200		
ゴールドウイン	15,000	9,266.000	138,990,000		
デサント	14,800	3,230.000	47,804,000		
特種東海製紙	4,000	3,740.000	14,960,000		
王子ホールディングス	357,100	671.900	239,935,490		
日本製紙	43,100	1,160.000	49,996,000		
北越コーポレーション	43,400	1,408.000	61,107,200		
大王製紙	39,700	1,147.000	45,535,900		
レンゴー	78,900	1,200.000	94,680,000		
トーモク	5,400	2,658.000	14,353,200		
ザ・パック	6,200	3,765.000	23,343,000		
北の達人コーポレーション	37,700	189.000	7,125,300		
クラレ	123,400	1,736.000	214,222,400		
旭化成	571,200	1,117.000	638,030,400		
レゾナック・ホールディングス	82,100	3,748.000	307,710,800		
住友化学	634,200	355.000	225,141,000		
住友精化	3,500	5,080.000	17,780,000		
日産化学	40,000	5,475.000	219,000,000		
ラサ工業	3,400	2,836.000	9,642,400		
クレハ	19,600	2,713.000	53,174,800		
多木化学	3,300	3,755.000	12,391,500		
テイカ	6,500	1,527.000	9,925,500		

石原産業	14,800	1,834.000	27,143,200		
日本曹達	9,100	5,980.000	54,418,000		
東ソー	113,000	2,178.000	246,114,000		
トクヤマ	29,000	2,901.000	84,129,000		
セントラル硝子	9,900	2,830.000	28,017,000		
東亞合成	41,100	1,653.500	67,958,850		
大阪ソーダ	5,900	9,150.000	53,985,000		
関東電化工業	16,400	993.000	16,285,200		
デンカ	30,800	2,348.000	72,318,400		
信越化学工業	758,300	6,543.000	4,961,556,900		
日本カーバイド工業	3,100	1,858.000	5,759,800		
堺化学工業	6,300	2,069.000	13,034,700		
第一稀元素化学工業	8,000	967.000	7,736,000		
エア・ウォーター	80,000	2,364.000	189,120,000		
日本酸素ホールディングス	82,000	4,499.000	368,918,000		
日本化学工業	3,000	2,550.000	7,650,000		
日本パーカライジング	39,000	1,235.000	48,165,000		
高圧ガス工業	12,600	885.000	11,151,000		
四国化成ホールディングス	11,000	1,695.000	18,645,000		
戸田工業	2,700	2,018.000	5,448,600		
ステラ　ケミファ	4,800	3,685.000	17,688,000		
保土谷化学工業	2,400	4,280.000	10,272,000		
日本触媒	50,400	1,523.000	76,759,200		
大日精化工業	5,800	2,961.000	17,173,800		
カネカ	23,900	4,021.000	96,101,900		
三菱瓦斯化学	62,900	2,838.500	178,541,650		
三井化学	72,000	4,539.000	326,808,000		
ＪＳＲ	77,200	4,345.000	335,434,000		
東京応化工業	42,000	4,250.000	178,500,000		
大阪有機化学工業	6,900	3,265.000	22,528,500		
三菱ケミカルグループ	616,900	927.100	571,927,990		
ＫＨネオケム	13,300	2,418.000	32,159,400		
ダイセル	110,600	1,466.000	162,139,600		
住友ベークライト	24,400	4,556.000	111,166,400		
積水化学工業	174,000	2,281.000	396,894,000		
日本ゼオン	59,000	1,373.000	81,007,000		
アイカ工業	22,000	3,739.000	82,258,000		
ＵＢＥ	41,900	2,858.000	119,750,200		
積水樹脂	11,900	2,700.000	32,130,000		
タキロンシーアイ	18,900	675.000	12,757,500		
旭有機材	5,500	5,420.000	29,810,000		
ニチバン	5,100	1,982.000	10,108,200		
リケンテクノス	18,200	994.000	18,090,800		
大倉工業	4,000	3,150.000	12,600,000		
群栄化学工業	2,100	3,785.000	7,948,500		
ミライアル	2,700	1,518.000	4,098,600		
ダイキョーニシカワ	18,600	761.000	14,154,600		
森六ホールディングス	4,400	2,671.000	11,752,400		

恵和	6,100	1,109.000	6,764,900		
日本化薬	69,000	1,320.000	91,080,000		
カーリットホールディングス	8,700	1,141.000	9,926,700		
日本精化	4,800	2,381.000	11,428,800		
扶桑化学工業	8,800	4,230.000	37,224,000		
トリケミカル研究所	10,500	4,500.000	47,250,000		
ＡＤＥＫＡ	30,000	3,327.000	99,810,000		
日油	76,500	2,121.500	162,294,750		
ハリマ化成グループ	5,800	927.000	5,376,600		
花王	191,200	6,249.000	1,194,808,800		
第一工業製薬	3,400	3,485.000	11,849,000		
石原ケミカル	4,000	1,784.000	7,136,000		
三洋化成工業	4,800	4,245.000	20,376,000		
大日本塗料	9,700	1,195.000	11,591,500		
日本ペイントホールディングス	450,200	1,014.000	456,502,800		
関西ペイント	83,300	2,084.000	173,597,200		
中国塗料	16,900	2,153.000	36,385,700		
日本特殊塗料	5,200	1,442.000	7,498,400		
藤倉化成	13,700	481.000	6,589,700		
太陽ホールディングス	14,200	3,155.000	44,801,000		
ＤＩＣ	33,200	2,996.000	99,467,200		
サカタインクス	18,300	1,645.000	30,103,500		
ａｒｔｉｅｎｃｅ	17,600	3,025.000	53,240,000		
富士フイルムホールディングス	471,000	3,454.000	1,626,834,000		
資生堂	177,200	3,979.000	705,078,800		
ライオン	111,800	1,355.000	151,489,000		
高砂香料工業	5,900	3,470.000	20,473,000		
マンダム	17,900	1,294.000	23,162,600		
ミルボン	11,700	3,016.000	35,287,200		
ファンケル	37,500	1,919.000	71,962,500		
コーセー	17,400	7,519.000	130,830,600		
コタ	6,600	1,425.000	9,405,000		
ポーラ・オルビスホールディングス	44,200	1,404.500	62,078,900		
ノエビアホールディングス	7,300	5,260.000	38,398,000		
新日本製薬	5,000	1,701.000	8,505,000		
Ｉ－ｎｅ	1,900	1,690.000	3,211,000		
アクシージア	4,800	896.000	4,300,800		
エステー	5,900	1,550.000	9,145,000		
アグロ　カネショウ	4,400	1,149.000	5,055,600		
コニシ	25,100	1,472.000	36,947,200		
長谷川香料	15,800	3,035.000	47,953,000		
小林製薬	25,000	5,606.000	140,150,000		
荒川化学工業	7,700	1,118.000	8,608,600		
メック	6,800	3,655.000	24,854,000		
日本高純度化学	2,100	3,210.000	6,741,000		
タカラバイオ	23,000	954.000	21,942,000		
ＪＣＵ	9,200	3,730.000	34,316,000		
新田ゼラチン	6,000	707.000	4,242,000		

ＯＡＴアグリオ	3,300	2,066.000	6,817,800		
デクセリアルズ	21,400	6,087.000	130,261,800		
アース製薬	7,400	4,325.000	32,005,000		
北興化学工業	9,600	1,469.000	14,102,400		
大成ラミック	3,500	2,910.000	10,185,000		
クミアイ化学工業	33,600	828.000	27,820,800		
日本農薬	15,900	764.000	12,147,600		
アキレス	5,700	1,555.000	8,863,500		
有沢製作所	14,400	1,506.000	21,686,400		
日東電工	54,600	14,500.000	791,700,000		
レック	12,300	1,153.000	14,181,900		
三光合成	11,700	692.000	8,096,400		
きもと	21,600	221.000	4,773,600		
藤森工業	6,300	4,425.000	27,877,500		
前澤化成工業	5,200	1,786.000	9,287,200		
未来工業	3,200	4,075.000	13,040,000		
ＪＳＰ	6,000	2,392.000	14,352,000		
エフピコ	16,500	2,813.000	46,414,500		
天馬	6,100	2,229.000	13,596,900		
信越ポリマー	17,400	1,549.000	26,952,600		
東リ	18,200	387.000	7,043,400		
ニフコ	26,000	3,929.000	102,154,000		
バルカー	6,800	4,810.000	32,708,000		
ユニ・チャーム	176,400	4,583.000	808,441,200		
協和キリン	99,100	2,669.500	264,547,450		
武田薬品工業	751,300	4,095.000	3,076,573,500		
アステラス製薬	746,200	1,446.000	1,079,005,200		
住友ファーマ	72,800	392.000	28,537,600		
塩野義製薬	107,500	7,237.000	777,977,500		
わかもと製薬	9,000	237.000	2,133,000		
日本新薬	20,300	4,280.000	86,884,000		
中外製薬	265,700	5,105.000	1,356,398,500		
科研製薬	12,000	3,428.000	41,136,000		
エーザイ	103,700	6,012.000	623,444,400		
ロート製薬	79,000	2,970.500	234,669,500		
小野薬品工業	176,400	2,348.500	414,275,400		
久光製薬	16,700	3,825.000	63,877,500		
持田製薬	11,300	3,165.000	35,764,500		
参天製薬	148,800	1,440.500	214,346,400		
扶桑薬品工業	4,500	2,239.000	10,075,500		
ツムラ	24,100	3,913.000	94,303,300		
キッセイ薬品工業	15,500	3,655.000	56,652,500		
生化学工業	19,000	756.000	14,364,000		
栄研化学	17,300	2,000.000	34,600,000		
鳥居薬品	5,300	3,895.000	20,643,500		
ＪＣＲファーマ	31,800	824.000	26,203,200		
東和薬品	14,500	2,783.000	40,353,500		
富士製薬工業	7,900	1,596.000	12,608,400		

ゼリア新薬工業	13,500	2,088.000	28,188,000		
ネクセラファーマ	29,300	1,513.000	44,330,900		
第一三共	738,300	4,561.000	3,367,386,300		
杏林製薬	21,900	1,828.000	40,033,200		
大幸薬品	24,400	358.000	8,735,200		
ダイト	8,000	2,422.000	19,376,000		
大塚ホールディングス	177,100	6,346.000	1,123,876,600		
ペプチドリーム	35,000	1,523.500	53,322,500		
セルソース	3,400	1,546.000	5,256,400		
あすか製薬ホールディングス	9,900	2,285.000	22,621,500		
サワイグループホールディングス	17,800	5,771.000	102,723,800		
日本コークス工業	84,800	134.000	11,363,200		
ニチレキ	10,500	2,396.000	25,158,000		
ユシロ化学工業	5,900	2,040.000	12,036,000		
富士石油	25,200	518.000	13,053,600		
出光興産	471,600	1,089.500	513,808,200		
ＥＮＥＯＳホールディングス	1,336,700	774.500	1,035,274,150		
コスモエネルギーホールディングス	25,400	7,942.000	201,726,800		
横浜ゴム	42,800	4,048.000	173,254,400		
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	48,900	2,948.500	144,181,650		
ブリヂストン	247,500	6,756.000	1,672,110,000		
住友ゴム工業	83,500	1,934.000	161,489,000		
藤倉コンポジット	5,600	1,465.000	8,204,000		
オカモト	4,100	4,800.000	19,680,000		
フコク	5,000	2,025.000	10,125,000		
ニッタ	8,200	4,050.000	33,210,000		
住友理工	13,800	1,323.000	18,257,400		
三ツ星ベルト	10,500	4,675.000	49,087,500		
バンドー化学	12,700	1,820.000	23,114,000		
日東紡績	10,900	5,600.000	61,040,000		
ＡＧＣ	75,500	5,912.000	446,356,000		
日本山村硝子	2,700	1,582.000	4,271,400		
日本電気硝子	34,700	3,825.000	132,727,500		
オハラ	5,300	1,360.000	7,208,000		
住友大阪セメント	14,500	3,853.000	55,868,500		
太平洋セメント	51,300	3,552.000	182,217,600		
日本ヒューム	8,400	839.000	7,047,600		
日本コンクリート工業	19,100	395.000	7,544,500		
三谷セキサン	4,000	6,120.000	24,480,000		
アジアパイルホールディングス	13,500	854.000	11,529,000		
東海カーボン	78,500	1,064.000	83,524,000		
日本カーボン	4,700	5,690.000	26,743,000		
東洋炭素	6,100	8,190.000	49,959,000		
ノリタケカンパニーリミテド	9,600	4,215.000	40,464,000		
ＴＯＴＯ	56,000	4,325.000	242,200,000		
日本碍子	98,200	2,116.000	207,791,200		
日本特殊陶業	70,700	5,337.000	377,325,900		
ダントーホールディングス	3,600	808.000	2,908,800		

ＭＡＲＵＷＡ	3,200	33,900.000	108,480,000		
品川リフラクトリーズ	10,700	1,924.000	20,586,800		
黒崎播磨	7,200	3,470.000	24,984,000		
ヨータイ	5,000	1,467.000	7,335,000		
東京窯業	10,700	485.000	5,189,500		
フジミインコーポレーテッド	22,800	3,500.000	79,800,000		
ニチアス	21,400	4,155.000	88,917,000		
ニチハ	10,800	3,670.000	39,636,000		
日本製鉄	389,800	3,601.000	1,403,669,800		
神戸製鋼所	175,800	1,972.500	346,765,500		
中山製鋼所	19,000	946.000	17,974,000		
合同製鐵	4,600	5,500.000	25,300,000		
ＪＦＥホールディングス	242,700	2,498.500	606,385,950		
東京製鐵	24,500	1,694.000	41,503,000		
共英製鋼	9,600	2,450.000	23,520,000		
大和工業	16,000	8,338.000	133,408,000		
東京鐵鋼	4,000	4,905.000	19,620,000		
大阪製鐵	5,300	2,343.000	12,417,900		
淀川製鋼所	9,300	4,595.000	42,733,500		
中部鋼鈑	5,900	2,385.000	14,071,500		
丸一鋼管	26,400	4,197.000	110,800,800		
モリ工業	2,000	6,900.000	13,800,000		
大同特殊鋼	54,500	1,782.500	97,146,250		
日本冶金工業	6,200	4,705.000	29,171,000		
山陽特殊製鋼	8,800	2,118.000	18,638,400		
愛知製鋼	5,100	3,945.000	20,119,500		
日本金属	3,600	848.000	3,052,800		
大平洋金属	8,100	1,317.000	10,667,700		
新日本電工	48,000	329.000	15,792,000		
栗本鐵工所	4,500	4,120.000	18,540,000		
三菱製鋼	6,400	1,435.000	9,184,000		
日本精線	6,500	1,214.000	7,891,000		
エンビプロ・ホールディングス	6,800	539.000	3,665,200		
新家工業	1,900	3,440.000	6,536,000		
大紀アルミニウム工業所	12,200	1,345.000	16,409,000		
日本軽金属ホールディングス	25,100	1,925.000	48,317,500		
三井金属鉱業	25,700	5,124.000	131,686,800		
三菱マテリアル	62,800	3,236.000	203,220,800		
住友金属鉱山	101,500	5,443.000	552,464,500		
ＤＯＷＡホールディングス	21,500	5,934.000	127,581,000		
古河機械金属	12,900	2,033.000	26,225,700		
大阪チタニウムテクノロジーズ	15,500	2,467.000	38,238,500		
東邦チタニウム	18,600	1,432.000	26,635,200		
ＵＡＣＪ	12,300	4,810.000	59,163,000		
ＣＫサンエツ	2,200	4,025.000	8,855,000		
古河電気工業	29,600	3,500.000	103,600,000		
住友電気工業	325,700	2,467.000	803,501,900		
フジクラ	103,300	2,789.500	288,155,350		

ＳＷＣＣ	9,700	4,130.000	40,061,000		
平河ヒューテック	5,500	1,320.000	7,260,000		
リョービ	9,700	2,828.000	27,431,600		
アーレスティ	7,100	828.000	5,878,800		
ＡＲＥホールディングス	34,300	2,038.000	69,903,400		
稲葉製作所	6,200	1,836.000	11,383,200		
宮地エンジニアリンググループ	4,300	4,055.000	17,436,500		
トーカロ	22,400	1,907.000	42,716,800		
アルファ	3,900	1,591.000	6,204,900		
ＳＵＭＣＯ	155,400	2,648.000	411,499,200		
川田テクノロジーズ	6,900	3,025.000	20,872,500		
ＲＳ　ＴＥＣＨＮＯＬＯＧＩＥＳ	5,900	3,340.000	19,706,000		
信和	7,900	748.000	5,909,200		
東洋製罐グループホールディングス	51,100	2,409.500	123,125,450		
ホッカンホールディングス	5,100	1,878.000	9,577,800		
横河ブリッジホールディングス	12,800	2,930.000	37,504,000		
三和ホールディングス	87,200	2,616.000	228,115,200		
文化シヤッター	23,900	1,722.000	41,155,800		
三協立山	11,100	831.000	9,224,100		
アルインコ	7,600	1,152.000	8,755,200		
ＬＩＸＩＬ	136,700	1,777.500	242,984,250		
ノーリツ	13,800	1,759.000	24,274,200		
長府製作所	8,400	2,229.000	18,723,600		
リンナイ	42,900	3,404.000	146,031,600		
日東精工	13,700	611.000	8,370,700		
岡部	16,300	824.000	13,431,200		
ジーテクト	10,400	2,045.000	21,268,000		
東プレ	15,100	2,682.000	40,498,200		
高周波熱錬	14,000	1,079.000	15,106,000		
東京製綱	5,700	1,406.000	8,014,200		
パイオラックス	11,500	2,652.000	30,498,000		
エイチワン	9,600	698.000	6,700,800		
日本発条	77,200	1,563.000	120,663,600		
中央発條	4,000	990.000	3,960,000		
立川ブラインド工業	4,400	1,427.000	6,278,800		
三益半導体工業	7,500	2,940.000	22,050,000		
日本製鋼所	23,500	3,921.000	92,143,500		
三浦工業	35,600	2,580.500	91,865,800		
タクマ	28,100	1,964.000	55,188,400		
ツガミ	18,000	1,265.000	22,770,000		
オークマ	7,800	7,099.000	55,372,200		
芝浦機械	8,500	3,480.000	29,580,000		
アマダ	134,800	1,737.500	234,215,000		
アイダエンジニアリング	16,400	895.000	14,678,000		
ＦＵＪＩ	39,600	2,652.500	105,039,000		
牧野フライス製作所	9,300	6,320.000	58,776,000		
オーエスジー	38,200	1,993.500	76,151,700		
旭ダイヤモンド工業	21,200	933.000	19,779,600		

ＤＭＧ森精機	51,400	4,287.000	220,351,800		
ソディック	22,400	740.000	16,576,000		
ディスコ	41,000	55,200.000	2,263,200,000		
日東工器	4,300	2,229.000	9,584,700		
日進工具	7,100	925.000	6,567,500		
冨士ダイス	5,200	684.000	3,556,800		
豊和工業	5,500	827.000	4,548,500		
石川製作所	3,100	1,418.000	4,395,800		
リケンＮＰＲ	9,200	3,160.000	29,072,000		
島精機製作所	13,500	1,319.000	17,806,500		
オプトラン	14,200	1,966.000	27,917,200		
ＮＣホールディングス	2,000	1,531.000	3,062,000		
イワキ	6,100	2,639.000	16,097,900		
フリュー	9,200	1,305.000	12,006,000		
ヤマシンフィルタ	21,800	448.000	9,766,400		
日阪製作所	8,800	1,093.000	9,618,400		
やまびこ	13,300	2,076.000	27,610,800		
野村マイクロ・サイエンス	11,600	5,330.000	61,828,000		
平田機工	4,000	7,550.000	30,200,000		
ＰＥＧＡＳＵＳ	11,000	499.000	5,489,000		
マルマエ	4,300	1,919.000	8,251,700		
タツモ	5,300	4,350.000	23,055,000		
ナブテスコ	53,900	2,542.000	137,013,800		
三井海洋開発	11,000	3,280.000	36,080,000		
レオン自動機	9,100	1,564.000	14,232,400		
ＳＭＣ	25,500	84,220.000	2,147,610,000		
ホソカワミクロン	5,700	4,580.000	26,106,000		
ユニオンツール	3,600	4,560.000	16,416,000		
瑞光	6,500	1,060.000	6,890,000		
オイレス工業	11,100	2,409.000	26,739,900		
日精エー・エス・ビー機械	3,400	5,020.000	17,068,000		
サトーホールディングス	11,600	2,261.000	26,227,600		
技研製作所	8,100	2,018.000	16,345,800		
日本エアーテック	5,400	1,203.000	6,496,200		
日精樹脂工業	6,400	1,120.000	7,168,000		
ワイエイシイホールディングス	3,100	2,384.000	7,390,400		
小松製作所	399,500	4,545.000	1,815,727,500		
住友重機械工業	50,200	4,743.000	238,098,600		
日立建機	34,000	4,831.000	164,254,000		
日工	11,000	750.000	8,250,000		
巴工業	3,700	4,425.000	16,372,500		
井関農機	8,400	1,089.000	9,147,600		
ＴＯＷＡ	9,600	10,390.000	99,744,000		
ローツェ	4,500	29,650.000	133,425,000		
クボタ	445,500	2,551.500	1,136,693,250		
荏原実業	4,400	3,535.000	15,554,000		
三菱化工機	2,900	3,885.000	11,266,500		
月島ホールディングス	11,500	1,462.000	16,813,000		

帝国電機製作所	5,900	2,485.000	14,661,500		
新東工業	16,700	1,333.000	22,261,100		
澁谷工業	8,000	3,625.000	29,000,000		
アイチコーポレーション	11,800	1,112.000	13,121,600		
小森コーポレーション	20,900	1,175.000	24,557,500		
鶴見製作所	6,300	3,705.000	23,341,500		
酒井重工業	1,400	6,450.000	9,030,000		
荏原製作所	34,900	13,775.000	480,747,500		
酉島製作所	7,600	2,757.000	20,953,200		
北越工業	8,700	1,890.000	16,443,000		
ダイキン工業	101,800	20,060.000	2,042,108,000		
オルガノ	10,300	7,270.000	74,881,000		
トーヨーカネツ	2,900	4,410.000	12,789,000		
栗田工業	47,700	6,417.000	306,090,900		
椿本チエイン	11,600	5,110.000	59,276,000		
大同工業	6,300	775.000	4,882,500		
木村化工機	8,700	774.000	6,733,800		
アネスト岩田	13,200	1,334.000	17,608,800		
ダイフク	144,100	3,486.000	502,332,600		
サムコ	2,300	4,630.000	10,649,000		
加藤製作所	3,200	1,453.000	4,649,600		
タダノ	48,900	1,340.000	65,526,000		
フジテック	20,500	3,787.000	77,633,500		
ＣＫＤ	23,900	3,195.000	76,360,500		
平和	26,700	1,925.000	51,397,500		
理想科学工業	7,100	3,025.000	21,477,500		
ＳＡＮＫＹＯ	88,000	1,650.500	145,244,000		
日本金銭機械	10,300	1,300.000	13,390,000		
マースグループホールディングス	4,800	3,215.000	15,432,000		
フクシマガリレイ	5,900	6,530.000	38,527,000		
ダイコク電機	4,600	3,565.000	16,399,000		
竹内製作所	15,300	5,940.000	90,882,000		
アマノ	23,900	3,839.000	91,752,100		
ＪＵＫＩ	13,700	555.000	7,603,500		
ジャノメ	9,400	669.000	6,288,600		
マックス	10,800	3,290.000	35,532,000		
グローリー	20,400	2,844.500	58,027,800		
新晃工業	8,200	3,975.000	32,595,000		
大和冷機工業	12,400	1,535.000	19,034,000		
セガサミーホールディングス	76,700	1,973.500	151,367,450		
ＴＰＲ	9,600	2,345.000	22,512,000		
ツバキ・ナカシマ	19,100	868.000	16,578,800		
ホシザキ	50,200	5,797.000	291,009,400		
大豊工業	9,000	899.000	8,091,000		
日本精工	157,600	886.300	139,680,880		
ＮＴＮ	185,600	311.700	57,851,520		
ジェイテクト	75,300	1,437.000	108,206,100		
不二越	6,300	3,465.000	21,829,500		

日本トムソン	20,600	653.000	13,451,800		
ＴＨＫ	49,400	3,552.000	175,468,800		
ユーシン精機	7,900	700.000	5,530,000		
前澤給装工業	6,900	1,282.000	8,845,800		
イーグル工業	9,300	1,823.000	16,953,900		
前澤工業	4,900	1,214.000	5,948,600		
日本ピラー工業	7,800	6,360.000	49,608,000		
キッツ	29,500	1,387.000	40,916,500		
マキタ	97,900	4,308.000	421,753,200		
三井Ｅ＆Ｓ	43,000	1,771.000	76,153,000		
日立造船	74,100	1,288.000	95,440,800		
三菱重工業	1,491,000	1,414.000	2,108,274,000		
ＩＨＩ	64,000	3,925.000	251,200,000		
スター精密	15,100	1,805.000	27,255,500		
日清紡ホールディングス	64,200	1,212.500	77,842,500		
イビデン	44,600	6,017.000	268,358,200		
コニカミノルタ	193,300	537.500	103,898,750		
ブラザー工業	114,100	2,916.500	332,772,650		
ミネベアミツミ	148,400	2,803.500	416,039,400		
日立製作所	409,700	14,630.000	5,993,911,000		
三菱電機	949,000	2,578.500	2,446,996,500		
富士電機	51,800	10,450.000	541,310,000		
東洋電機製造	5,000	1,144.000	5,720,000		
安川電機	92,700	6,294.000	583,453,800		
シンフォニア　テクノロジー	10,000	3,485.000	34,850,000		
明電舎	15,500	3,350.000	51,925,000		
オリジン	3,500	1,198.000	4,193,000		
山洋電気	3,600	7,300.000	26,280,000		
デンヨー	6,800	2,379.000	16,177,200		
ＰＨＣホールディングス	16,400	1,130.000	18,532,000		
ＫＯＫＵＳＡＩ　ＥＬＥＣＴＲＩＣ	33,100	4,220.000	139,682,000		
ソシオネクスト	62,100	4,927.000	305,966,700		
東芝テック	11,300	3,125.000	35,312,500		
芝浦メカトロニクス	5,000	6,390.000	31,950,000		
マブチモーター	41,600	2,653.000	110,364,800		
ニデック	188,500	6,351.000	1,197,163,500		
トレックス・セミコンダクター	4,300	1,754.000	7,542,200		
東光高岳	5,300	2,642.000	14,002,600		
ダイヘン	8,300	10,800.000	89,640,000		
ヤーマン	16,800	980.000	16,464,000		
ＪＶＣケンウッド	69,200	913.000	63,179,600		
ミマキエンジニアリング	9,000	1,173.000	10,557,000		
Ｉ－ＰＥＸ	6,200	1,816.000	11,259,200		
大崎電気工業	21,000	680.000	14,280,000		
オムロン	65,200	5,206.000	339,431,200		
日東工業	11,200	4,155.000	46,536,000		
ＩＤＥＣ	12,300	2,671.000	32,853,300		
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	33,600	3,145.000	105,672,000		

サクサホールディングス	1,700	2,824.000	4,800,800		
メルコホールディングス	3,300	3,695.000	12,193,500		
日本電気	112,000	11,475.000	1,285,200,000		
富士通	785,000	2,528.500	1,984,872,500		
沖電気工業	39,200	1,158.000	45,393,600		
電気興業	3,700	2,074.000	7,673,800		
サンケン電気	8,000	6,060.000	48,480,000		
アイホン	4,900	2,984.000	14,621,600		
ルネサスエレクトロニクス	535,600	2,683.000	1,437,014,800		
セイコーエプソン	109,400	2,705.000	295,927,000		
ワコム	64,900	587.000	38,096,300		
アルバック	19,000	10,060.000	191,140,000		
アクセル	4,400	1,720.000	7,568,000		
ＥＩＺＯ	6,100	5,210.000	31,781,000		
日本信号	19,000	1,035.000	19,665,000		
京三製作所	19,500	519.000	10,120,500		
能美防災	11,200	2,601.000	29,131,200		
ホーチキ	6,400	2,260.000	14,464,000		
エレコム	20,000	1,521.000	30,420,000		
パナソニック　ホールディングス	1,007,700	1,398.000	1,408,764,600		
シャープ	145,800	821.600	119,789,280		
アンリツ	61,200	1,247.000	76,316,400		
富士通ゼネラル	24,800	1,810.500	44,900,400		
ソニーグループ	597,300	12,860.000	7,681,278,000		
ＴＤＫ	135,100	7,690.000	1,038,919,000		
帝国通信工業	4,100	1,831.000	7,507,100		
タムラ製作所	36,200	596.000	21,575,200		
アルプスアルパイン	77,800	1,259.000	97,950,200		
日本電波工業	10,800	1,234.000	13,327,200		
鈴木	5,300	1,346.000	7,133,800		
メイコー	8,900	5,150.000	45,835,000		
日本トリム	2,200	3,635.000	7,997,000		
フォスター電機	8,200	1,265.000	10,373,000		
ＳＭＫ	2,500	2,505.000	6,262,500		
ヨコオ	7,300	1,620.000	11,826,000		
ホシデン	19,300	1,938.000	37,403,400		
ヒロセ電機	12,600	15,845.000	199,647,000		
日本航空電子工業	20,500	2,390.000	48,995,000		
ＴＯＡ	10,100	1,139.000	11,503,900		
マクセル	18,900	1,555.000	29,389,500		
古野電気	11,500	2,297.000	26,415,500		
スミダコーポレーション	11,500	1,230.000	14,145,000		
アイコム	3,600	3,280.000	11,808,000		
リオン	3,800	3,085.000	11,723,000		
横河電機	93,400	3,554.000	331,943,600		
新電元工業	3,400	2,916.000	9,914,400		
アズビル	57,900	4,279.000	247,754,100		
東亜ディーケーケー	5,600	909.000	5,090,400		

日本光電工業	36,400	4,144.000	150,841,600		
チノー	3,700	2,700.000	9,990,000		
日本電子材料	6,500	2,686.000	17,459,000		
堀場製作所	16,100	15,925.000	256,392,500		
アドバンテスト	241,800	5,938.000	1,435,808,400		
エスペック	7,100	3,045.000	21,619,500		
キーエンス	84,500	64,700.000	5,467,150,000		
日置電機	4,100	7,070.000	28,987,000		
シスメックス	218,700	2,447.500	535,268,250		
日本マイクロニクス	15,300	7,740.000	118,422,000		
メガチップス	6,800	3,575.000	24,310,000		
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	5,900	4,220.000	24,898,000		
コーセル	9,800	1,474.000	14,445,200		
イリソ電子工業	7,700	2,902.000	22,345,400		
オプテックスグループ	15,100	1,875.000	28,312,500		
千代田インテグレ	3,800	2,791.000	10,605,800		
レーザーテック	38,700	42,180.000	1,632,366,000		
スタンレー電気	54,100	2,828.000	152,994,800		
ウシオ電機	43,300	1,999.000	86,556,700		
ヘリオス　テクノ　ホールディング	6,200	495.000	3,069,000		
日本セラミック	7,500	2,727.000	20,452,500		
遠藤照明	3,200	1,470.000	4,704,000		
古河電池	6,300	1,040.000	6,552,000		
山一電機	7,300	2,698.000	19,695,400		
図研	7,200	4,140.000	29,808,000		
日本電子	21,200	7,330.000	155,396,000		
カシオ計算機	61,600	1,327.500	81,774,000		
ファナック	411,700	4,396.000	1,809,833,200		
日本シイエムケイ	19,800	599.000	11,860,200		
エンプラス	2,600	7,120.000	18,512,000		
大真空	12,100	791.000	9,571,100		
ローム	156,500	2,232.500	349,386,250		
浜松ホトニクス	67,600	5,680.000	383,968,000		
三井ハイテック	7,400	7,307.000	54,071,800		
新光電気工業	29,100	5,606.000	163,134,600		
京セラ	524,400	1,913.000	1,003,177,200		
太陽誘電	41,500	3,623.000	150,354,500		
村田製作所	767,800	2,785.000	2,138,323,000		
双葉電子工業	17,400	508.000	8,839,200		
北陸電気工業	3,200	1,365.000	4,368,000		
ニチコン	21,200	1,328.000	28,153,600		
ＫＯＡ	12,700	1,475.000	18,732,500		
市光工業	15,900	520.000	8,268,000		
小糸製作所	89,100	2,335.500	208,093,050		
ミツバ	16,200	1,545.000	25,029,000		
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	28,800	18,520.000	533,376,000		
キヤノン電子	9,100	2,346.000	21,348,600		
キヤノン	421,100	4,488.000	1,889,896,800		

リコー	212,400	1,395.000	296,298,000		
象印マホービン	23,500	1,479.000	34,756,500		
東京エレクトロン	178,700	39,290.000	7,021,123,000		
イノテック	5,400	1,865.000	10,071,000		
トヨタ紡織	35,100	2,550.500	89,522,550		
ユニプレス	15,100	1,164.000	17,576,400		
豊田自動織機	72,100	14,370.000	1,036,077,000		
モリタホールディングス	14,600	1,693.000	24,717,800		
三櫻工業	13,000	1,142.000	14,846,000		
デンソー	696,000	2,968.000	2,065,728,000		
東海理化電機製作所	22,700	2,532.000	57,476,400		
川崎重工業	69,200	4,918.000	340,325,600		
名村造船所	21,500	1,885.000	40,527,500		
日本車輌製造	3,300	2,441.000	8,055,300		
三菱ロジスネクスト	15,200	1,666.000	25,323,200		
日産自動車	1,140,700	586.500	669,020,550		
いすゞ自動車	245,200	2,009.500	492,729,400		
トヨタ自動車	4,636,000	3,767.000	17,463,812,000		
日野自動車	120,000	506.200	60,744,000		
三菱自動車工業	331,500	509.500	168,899,250		
武蔵精密工業	20,200	1,639.000	33,107,800		
日産車体	6,500	1,012.000	6,578,000		
新明和工業	25,900	1,220.000	31,598,000		
極東開発工業	13,900	2,562.000	35,611,800		
トピー工業	7,100	2,752.000	19,539,200		
ティラド	2,400	4,010.000	9,624,000		
タチエス	14,900	1,959.000	29,189,100		
ＮＯＫ	33,200	2,145.500	71,230,600		
フタバ産業	23,900	1,090.000	26,051,000		
カヤバ	7,800	5,220.000	40,716,000		
大同メタル工業	19,500	681.000	13,279,500		
プレス工業	36,200	755.000	27,331,000		
太平洋工業	18,400	1,734.000	31,905,600		
アイシン	65,200	6,100.000	397,720,000		
マツダ	279,800	1,809.500	506,298,100		
今仙電機製作所	6,300	612.000	3,855,600		
本田技研工業	2,007,100	1,860.000	3,733,206,000		
スズキ	620,000	1,836.000	1,138,320,000		
ＳＵＢＡＲＵ	261,300	3,577.000	934,670,100		
安永	4,400	671.000	2,952,400		
ヤマハ発動機	364,200	1,411.000	513,886,200		
エクセディ	13,000	3,065.000	39,845,000		
豊田合成	23,800	3,286.000	78,206,800		
愛三工業	14,000	1,667.000	23,338,000		
日本プラスト	10,500	526.000	5,523,000		
ヨロズ	9,500	1,001.000	9,509,500		
エフ・シー・シー	14,200	2,287.000	32,475,400		
シマノ	34,200	23,700.000	810,540,000		

テイ・エス　テック	32,200	1,954.500	62,934,900		
ジャムコ	4,100	1,146.000	4,698,600		
テルモ	471,800	2,587.500	1,220,782,500		
日機装	19,100	1,285.000	24,543,500		
日本エム・ディ・エム	5,400	680.000	3,672,000		
島津製作所	111,900	4,181.000	467,853,900		
長野計器	6,200	2,541.000	15,754,200		
ブイ・テクノロジー	4,600	2,577.000	11,854,200		
東京計器	6,700	2,681.000	17,962,700		
愛知時計電機	3,800	2,389.000	9,078,200		
インターアクション	5,200	1,512.000	7,862,400		
オーバル	7,300	577.000	4,212,100		
東京精密	17,500	11,625.000	203,437,500		
マニー	33,800	1,780.000	60,164,000		
ニコン	122,500	1,566.500	191,896,250		
トプコン	42,400	1,732.000	73,436,800		
オリンパス	503,500	2,188.500	1,101,909,750		
理研計器	11,600	3,595.000	41,702,000		
タムロン	5,200	6,840.000	35,568,000		
ＨＯＹＡ	166,200	17,020.000	2,828,724,000		
ノーリツ鋼機	8,000	3,085.000	24,680,000		
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	11,900	2,973.000	35,378,700		
朝日インテック	103,100	2,316.500	238,831,150		
シチズン時計	78,100	1,079.000	84,269,900		
リズム	1,300	3,020.000	3,926,000		
メニコン	29,600	1,451.000	42,949,600		
松風	3,900	2,927.000	11,415,300		
セイコーグループ	12,400	4,365.000	54,126,000		
ニプロ	70,800	1,295.000	91,686,000		
パラマウントベッドホールディングス	18,900	2,760.000	52,164,000		
トランザクション	5,600	1,970.000	11,032,000		
ニホンフラッシュ	8,600	922.000	7,929,200		
前田工繊	7,000	3,360.000	23,520,000		
永大産業	17,800	288.000	5,126,400		
アートネイチャー	9,800	764.000	7,487,200		
フルヤ金属	2,100	12,070.000	25,347,000		
バンダイナムコホールディングス	232,000	2,880.000	668,160,000		
ＳＨＯＥＩ	18,700	2,163.000	40,448,100		
フランスベッドホールディングス	10,500	1,222.000	12,831,000		
パイロットコーポレーション	12,400	4,142.000	51,360,800		
萩原工業	6,300	1,638.000	10,319,400		
フジシールインターナショナル	17,100	2,114.000	36,149,400		
タカラトミー	38,600	2,635.000	101,711,000		
広済堂ホールディングス	22,400	691.000	15,478,400		
プロネクサス	7,700	1,151.000	8,862,700		
ＴＯＰＰＡＮホールディングス	104,100	3,756.000	390,999,600		
大日本印刷	92,400	4,544.000	419,865,600		
共同印刷	2,800	3,425.000	9,590,000		

ＮＩＳＳＨＡ	15,100	1,547.000	23,359,700		
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	5,300	2,648.000	14,034,400		
アシックス	72,100	6,980.000	503,258,000		
ツツミ	3,200	2,111.000	6,755,200		
ローランド	6,300	4,340.000	27,342,000		
小松ウオール工業	3,300	3,115.000	10,279,500		
ヤマハ	53,700	3,169.000	170,175,300		
河合楽器製作所	2,500	3,615.000	9,037,500		
クリナップ	9,800	758.000	7,428,400		
ピジョン	54,800	1,410.000	77,268,000		
キングジム	8,800	891.000	7,840,800		
リンテック	16,700	3,145.000	52,521,500		
イトーキ	17,400	1,871.000	32,555,400		
任天堂	533,100	7,668.000	4,087,810,800		
三菱鉛筆	12,000	2,564.000	30,768,000		
タカラスタンダード	17,700	1,862.000	32,957,400		
コクヨ	36,200	2,640.000	95,568,000		
グローブライド	7,000	1,935.000	13,545,000		
オカムラ	25,200	2,347.000	59,144,400		
美津濃	8,400	7,570.000	63,588,000		
東京電力ホールディングス	763,200	1,107.500	845,244,000		
中部電力	310,400	2,078.000	645,011,200		
関西電力	325,700	2,454.000	799,267,800		
中国電力	146,200	1,258.000	183,919,600		
北陸電力	86,900	950.200	82,572,380		
東北電力	221,100	1,296.500	286,656,150		
四国電力	77,300	1,332.500	103,002,250		
九州電力	193,800	1,668.000	323,258,400		
北海道電力	80,600	1,213.000	97,767,800		
沖縄電力	20,600	1,262.000	25,997,200		
電源開発	69,300	2,716.500	188,253,450		
エフオン	9,900	443.000	4,385,700		
イーレックス	16,400	762.000	12,496,800		
レノバ	23,200	1,351.000	31,343,200		
東京瓦斯	165,700	3,891.000	644,738,700		
大阪瓦斯	171,200	3,433.000	587,729,600		
東邦瓦斯	36,700	3,684.000	135,202,800		
北海道瓦斯	4,900	3,015.000	14,773,500		
広島ガス	19,100	387.000	7,391,700		
西部ガスホールディングス	7,800	1,978.000	15,428,400		
静岡ガス	18,000	976.000	17,568,000		
メタウォーター	9,800	2,380.000	23,324,000		
ＳＢＳホールディングス	7,200	2,787.000	20,066,400		
東武鉄道	92,100	3,520.000	324,192,000		
相鉄ホールディングス	29,800	2,714.000	80,877,200		
東急	235,800	1,900.000	448,020,000		
京浜急行電鉄	103,200	1,340.000	138,288,000		
小田急電鉄	139,600	1,843.000	257,282,800		

京王電鉄	41,900	4,087.000	171,245,300		
京成電鉄	54,400	6,075.000	330,480,000		
富士急行	10,300	3,645.000	37,543,500		
東日本旅客鉄道	465,000	2,967.000	1,379,655,000		
西日本旅客鉄道	201,800	3,115.000	628,607,000		
東海旅客鉄道	324,900	3,677.000	1,194,657,300		
西武ホールディングス	102,400	2,571.500	263,321,600		
鴻池運輸	14,000	2,277.000	31,878,000		
西日本鉄道	21,600	2,463.000	53,200,800		
ハマキョウレックス	6,300	3,965.000	24,979,500		
サカイ引越センター	9,100	2,780.000	25,298,000		
近鉄グループホールディングス	84,000	4,340.000	364,560,000		
阪急阪神ホールディングス	112,000	4,285.000	479,920,000		
南海電気鉄道	39,300	3,048.000	119,786,400		
京阪ホールディングス	46,300	3,411.000	157,929,300		
神戸電鉄	2,700	2,779.000	7,503,300		
名古屋鉄道	89,800	2,149.000	192,980,200		
山陽電気鉄道	6,400	2,094.000	13,401,600		
アルプス物流	6,700	3,010.000	20,167,000		
ヤマトホールディングス	108,400	2,138.000	231,759,200		
山九	21,500	5,348.000	114,982,000		
丸全昭和運輸	5,000	4,785.000	23,925,000		
センコーグループホールディングス	42,900	1,192.000	51,136,800		
トナミホールディングス	1,900	4,885.000	9,281,500		
ニッコンホールディングス	26,300	2,991.000	78,663,300		
福山通運	9,700	3,825.000	37,102,500		
セイノーホールディングス	47,800	2,162.500	103,367,500		
神奈川中央交通	2,600	3,150.000	8,190,000		
ＡＺ－ＣＯＭ丸和ホールディングス	21,800	1,260.000	27,468,000		
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	8,300	3,300.000	27,390,000		
九州旅客鉄道	59,000	3,575.000	210,925,000		
ＳＧホールディングス	143,300	1,840.500	263,743,650		
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	28,600	8,076.000	230,973,600		
日本郵船	240,800	4,188.000	1,008,470,400		
商船三井	182,300	4,664.000	850,247,200		
川崎汽船	203,400	2,078.500	422,766,900		
ＮＳユナイテッド海運	4,700	4,660.000	21,902,000		
明海グループ	7,400	737.000	5,453,800		
飯野海運	31,300	1,228.000	38,436,400		
乾汽船	12,600	1,080.000	13,608,000		
日本航空	207,600	2,837.000	588,961,200		
ＡＮＡホールディングス	228,500	3,100.000	708,350,000		
トランコム	2,400	5,920.000	14,208,000		
日新	6,500	3,150.000	20,475,000		
三菱倉庫	20,500	5,139.000	105,349,500		
三井倉庫ホールディングス	7,600	4,695.000	35,682,000		
住友倉庫	21,500	2,680.000	57,620,000		

澁澤倉庫	3,300	3,045.000	10,048,500		
東陽倉庫	3,700	1,547.000	5,723,900		
日本トランスシティ	16,800	736.000	12,364,800		
川西倉庫	5,200	1,160.000	6,032,000		
安田倉庫	6,500	1,363.000	8,859,500		
上組	39,000	3,327.000	129,753,000		
キムラユニティー	4,000	1,708.000	6,832,000		
キユーソー流通システム	6,700	1,232.000	8,254,400		
エーアイテイー	5,400	1,763.000	9,520,200		
内外トランスライン	3,500	2,550.000	8,925,000		
日本コンセプト	3,300	1,793.000	5,916,900		
ＮＥＣネッツエスアイ	32,200	2,631.000	84,718,200		
クロスキャット	5,200	1,352.000	7,030,400		
システナ	134,900	259.000	34,939,100		
デジタルアーツ	5,300	4,365.000	23,134,500		
日鉄ソリューションズ	14,100	5,330.000	75,153,000		
キューブシステム	3,500	1,101.000	3,853,500		
コア	3,300	1,895.000	6,253,500		
手間いらず	1,900	3,135.000	5,956,500		
ラクーンホールディングス	8,100	649.000	5,256,900		
ソリトンシステムズ	4,800	1,336.000	6,412,800		
ソフトクリエイトホールディングス	7,100	1,805.000	12,815,500		
ＴＩＳ	92,700	3,232.000	299,606,400		
グリー	23,300	470.000	10,951,000		
コーエーテクモホールディングス	53,200	1,536.000	81,715,200		
三菱総合研究所	3,900	5,060.000	19,734,000		
ファインデックス	7,900	1,068.000	8,437,200		
ブレインパッド	7,400	1,280.000	9,472,000		
ＫＬａｂ	9,100	267.000	2,429,700		
ポールトゥウィンホールディングス	15,000	488.000	7,320,000		
ネクソン	189,100	2,411.000	455,920,100		
アイスタイル	29,200	493.000	14,395,600		
エムアップホールディングス	10,900	1,052.000	11,466,800		
エイチーム	6,700	649.000	4,348,300		
エニグモ	12,700	365.000	4,635,500		
コロプラ	32,000	594.000	19,008,000		
ブロードリーフ	42,900	577.000	24,753,300		
デジタルハーツホールディングス	5,700	942.000	5,369,400		
メディアドゥ	4,300	1,474.000	6,338,200		
じげん	24,900	555.000	13,819,500		
フィックスターズ	9,800	2,118.000	20,756,400		
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	4,400	1,712.000	7,532,800		
オプティム	8,500	920.000	7,820,000		
セレス	3,800	1,769.000	6,722,200		
ＳＨＩＦＴ	5,700	16,950.000	96,615,000		
ティーガイア	9,000	2,084.000	18,756,000		
セック	1,000	4,730.000	4,730,000		
テクマトリックス	15,700	1,707.000	26,799,900		

プロシップ	3,900	1,436.000	5,600,400		
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	22,400	2,266.000	50,758,400		
GMOペイメントゲートウェイ	17,100	7,928.000	135,568,800		
システムリサーチ	5,600	1,534.000	8,590,400		
インターネットイニシアティブ	41,200	2,736.000	112,723,200		
さくらインターネット	9,600	5,740.000	55,104,000		
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2,700	2,850.000	7,695,000		
ＳＲＡホールディングス	4,200	4,085.000	17,157,000		
朝日ネット	5,600	642.000	3,595,200		
ｅＢＡＳＥ	12,200	692.000	8,442,400		
アバントグループ	10,700	1,247.000	13,342,900		
アドソル日進	3,500	1,631.000	5,708,500		
フリービット	4,600	1,431.000	6,582,600		
コムチュア	11,700	1,907.000	22,311,900		
アイル	4,000	2,755.000	11,020,000		
マークラインズ	4,700	3,125.000	14,687,500		
メディカル・データ・ビジョン	12,600	613.000	7,723,800		
テラスカイ	4,100	1,670.000	6,847,000		
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,700	1,699.000	7,985,300		
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	2,200	1,851.000	4,072,200		
ラクス	40,200	1,638.000	65,847,600		
ダブルスタンダード	3,400	1,776.000	6,038,400		
オープンドア	6,300	754.000	4,750,200		
アカツキ	4,400	2,423.000	10,661,200		
ＵＢＩＣＯＭホールディングス	3,100	1,185.000	3,673,500		
カナミックネットワーク	11,900	507.000	6,033,300		
チェンジホールディングス	19,600	1,166.000	22,853,600		
オークネット	3,500	2,565.000	8,977,500		
マクロミル	17,000	759.000	12,903,000		
オロ	3,600	2,719.000	9,788,400		
ユーザーローカル	3,700	2,145.000	7,936,500		
マネーフォワード	19,100	5,495.000	104,954,500		
ＳＵＮ　ＡＳＴＥＲＩＳＫ	6,600	892.000	5,887,200		
プラスアルファ・コンサルティング	5,200	2,163.000	11,247,600		
電算システムホールディングス	4,200	2,768.000	11,625,600		
ＡＰＰＩＥＲ　ＧＲＯＵＰ	29,400	1,317.000	38,719,800		
ビジョナル	6,600	8,050.000	53,130,000		
プロトコーポレーション	9,900	1,420.000	14,058,000		
野村総合研究所	187,700	3,981.000	747,233,700		
日本システム技術	5,600	1,773.000	9,928,800		
インテージホールディングス	9,600	1,491.000	14,313,600		
インフォコム	10,700	2,762.000	29,553,400		
シンプレクス・ホールディングス	13,500	2,769.000	37,381,500		
ＨＥＲＯＺ	4,100	1,518.000	6,223,800		
ラクスル	21,400	936.000	20,030,400		
メルカリ	42,500	1,745.500	74,183,750		
ＩＰＳ	2,900	2,350.000	6,815,000		

システムサポート	3,300	1,986.000	6,553,800		
イーソル	7,500	801.000	6,007,500		
ウイングアーク１ｓｔ	9,000	2,691.000	24,219,000		
サーバーワークス	2,100	2,616.000	5,493,600		
Ｓａｎｓａｎ	28,400	1,411.000	40,072,400		
ギフティ	8,000	1,253.000	10,024,000		
メドレー	11,400	3,995.000	45,543,000		
ベース	3,100	3,445.000	10,679,500		
ＪＭＤＣ	14,800	3,167.000	46,871,600		
フォーカスシステムズ	6,000	1,258.000	7,548,000		
クレスコ	7,000	2,130.000	14,910,000		
フジ・メディア・ホールディングス	82,000	2,024.500	166,009,000		
オービック	28,300	21,120.000	597,696,000		
ジャストシステム	12,300	2,589.000	31,844,700		
ＴＤＣソフト	14,400	1,122.000	16,156,800		
ＬＩＮＥヤフー	1,209,600	357.600	432,552,960		
トレンドマイクロ	40,200	8,042.000	323,288,400		
ＩＤホールディングス	5,900	1,478.000	8,720,200		
日本オラクル	16,600	11,335.000	188,161,000		
アルファシステムズ	2,500	3,245.000	8,112,500		
フューチャー	18,500	1,774.000	32,819,000		
ＣＡＣ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	4,300	2,016.000	8,668,800		
ＳＢテクノロジー	3,700	2,084.000	7,710,800		
オービックビジネスコンサルタント	12,300	7,038.000	86,567,400		
アイティフォー	10,900	1,395.000	15,205,500		
東計電算	2,800	4,000.000	11,200,000		
大塚商会	84,200	3,147.000	264,977,400		
サイボウズ	12,000	1,558.000	18,696,000		
電通総研	10,200	5,000.000	51,000,000		
ＡＣＣＥＳＳ	10,400	1,441.000	14,986,400		
デジタルガレージ	14,300	2,919.000	41,741,700		
イーエムシステムズ	14,500	669.000	9,700,500		
ウェザーニューズ	2,500	4,555.000	11,387,500		
ＣＩＪ	22,000	505.000	11,110,000		
ビジネスエンジニアリング	1,500	3,550.000	5,325,000		
WOWOW	7,000	1,120.000	7,840,000		
スカラ	7,900	728.000	5,751,200		
ＡＮＹＣＯＬＯＲ	9,100	2,312.000	21,039,200		
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	8,500	639.000	5,431,500		
ネットワンシステムズ	34,800	2,731.000	95,038,800		
アルゴグラフィックス	7,500	3,975.000	29,812,500		
マーベラス	14,200	682.000	9,684,400		
エイベックス	14,200	1,285.000	18,247,000		
ＢＩＰＲＯＧＹ	27,800	4,652.000	129,325,600		
都築電気	4,500	2,274.000	10,233,000		
ＴＢＳホールディングス	42,800	4,785.000	204,798,000		
日本テレビホールディングス	75,600	2,503.000	189,226,800		
朝日放送グループホールディングス	9,600	653.000	6,268,800		

テレビ朝日ホールディングス	20,800	2,250.000	46,800,000		
スカパーＪＳＡＴホールディングス	67,900	989.000	67,153,100		
テレビ東京ホールディングス	6,000	3,035.000	18,210,000		
日本ＢＳ放送	3,500	917.000	3,209,500		
ビジョン	12,800	1,047.000	13,401,600		
Ｕ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	9,400	4,515.000	42,441,000		
日本通信	83,500	197.000	16,449,500		
日本電信電話	25,179,100	174.600	4,396,270,860		
ＫＤＤＩ	654,100	4,281.000	2,800,202,100		
ソフトバンク	1,361,800	1,861.500	2,534,990,700		
光通信	8,600	26,815.000	230,609,000		
エムティーアイ	7,400	735.000	5,439,000		
ＧＭＯインターネットグループ	31,300	2,663.500	83,367,550		
ファイバーゲート	5,000	1,060.000	5,300,000		
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	44,800	2,777.000	124,409,600		
学研ホールディングス	14,400	950.000	13,680,000		
ゼンリン	14,500	838.000	12,151,000		
アイネット	5,600	2,266.000	12,689,600		
松竹	4,700	9,337.000	43,883,900		
東宝	47,200	4,971.000	234,631,200		
東映	14,000	3,800.000	53,200,000		
ＮＴＴデータグループ	222,500	2,326.500	517,646,250		
ピー・シー・エー	5,200	1,797.000	9,344,400		
ビジネスブレイン太田昭和	3,300	2,020.000	6,666,000		
ＤＴＳ	17,200	4,075.000	70,090,000		
スクウェア・エニックス・ホールディングス	39,100	5,434.000	212,469,400		
シーイーシー	11,700	1,696.000	19,843,200		
カプコン	151,600	2,640.500	400,299,800		
アイ・エス・ビー	4,600	1,301.000	5,984,600		
ジャステック	5,100	1,936.000	9,873,600		
ＳＣＳＫ	59,000	2,836.000	167,324,000		
ＮＳＷ	3,300	3,055.000	10,081,500		
アイネス	6,300	1,521.000	9,582,300		
ＴＫＣ	12,700	3,855.000	48,958,500		
富士ソフト	17,200	6,130.000	105,436,000		
ＮＳＤ	29,700	3,030.000	89,991,000		
コナミグループ	32,000	9,368.000	299,776,000		
福井コンピュータホールディングス	5,200	2,535.000	13,182,000		
ＪＢＣＣホールディングス	5,900	3,230.000	19,057,000		
ミロク情報サービス	7,900	1,700.000	13,430,000		
ソフトバンクグループ	417,900	8,322.000	3,477,763,800		
リョーサン菱洋ホールディングス	17,200	3,015.000	51,858,000		
高千穂交易	2,600	3,755.000	9,763,000		
伊藤忠食品	2,000	7,250.000	14,500,000		
エレマテック	8,000	1,867.000	14,936,000		
あらた	13,400	3,130.000	41,942,000		
トーメンデバイス	1,400	6,570.000	9,198,000		
東京エレクトロン　デバイス	9,000	6,260.000	56,340,000		

円谷フィールズホールディングス	15,700	1,641.000	25,763,700		
双日	99,500	4,024.000	400,388,000		
アルフレッサ　ホールディングス	90,200	2,210.000	199,342,000		
横浜冷凍	24,300	1,024.000	24,883,200		
ラサ商事	5,000	1,975.000	9,875,000		
アルコニックス	12,000	1,451.000	17,412,000		
神戸物産	69,400	3,432.000	238,180,800		
あい　ホールディングス	13,800	2,514.000	34,693,200		
ダイワボウホールディングス	39,700	2,626.500	104,272,050		
マクニカホールディングス	21,200	7,189.000	152,406,800		
ラクト・ジャパン	3,800	2,462.000	9,355,600		
グリムス	3,800	2,080.000	7,904,000		
バイタルケーエスケー・ホールディングス	13,400	1,232.000	16,508,800		
八洲電機	2,200	1,551.000	3,412,200		
メディアスホールディングス	7,000	769.000	5,383,000		
レスター	8,000	2,982.000	23,856,000		
ジオリーブグループ	1,600	1,300.000	2,080,000		
ＴＯＫＡＩホールディングス	42,400	956.000	40,534,400		
三洋貿易	9,900	1,490.000	14,751,000		
ビューティガレージ	3,000	1,962.000	5,886,000		
ウイン・パートナーズ	5,200	1,199.000	6,234,800		
シップヘルスケアホールディングス	32,800	2,135.000	70,028,000		
コメダホールディングス	21,600	2,612.000	56,419,200		
フルサト・マルカホールディングス	8,300	2,032.000	16,865,600		
ヤマエグループホールディングス	6,100	2,721.000	16,598,100		
小野建	8,700	1,854.000	16,129,800		
南陽	5,000	1,228.000	6,140,000		
佐鳥電機	4,600	2,329.000	10,713,400		
エコートレーディング	2,500	1,214.000	3,035,000		
伯東	5,000	5,450.000	27,250,000		
コンドーテック	7,000	1,270.000	8,890,000		
ナガイレーベン	11,000	2,393.000	26,323,000		
三菱食品	9,300	5,520.000	51,336,000		
松田産業	6,800	2,689.000	18,285,200		
第一興商	34,400	1,885.500	64,861,200		
メディパルホールディングス	91,200	2,411.000	219,883,200		
ＳＰＫ	4,200	2,050.000	8,610,000		
萩原電気ホールディングス	4,300	4,170.000	17,931,000		
アズワン	28,200	2,631.500	74,208,300		
スズデン	3,800	2,086.000	7,926,800		
尾家産業	2,500	1,651.000	4,127,500		
シモジマ	6,600	1,336.000	8,817,600		
ドウシシャ	8,800	2,177.000	19,157,600		
高速	4,900	2,146.000	10,515,400		
たけびし	3,400	2,174.000	7,391,600		
リックス	2,000	4,475.000	8,950,000		
丸文	8,300	1,487.000	12,342,100		
ハピネット	7,900	2,900.000	22,910,000		

日本ライフライン	25,900	1,175.000	30,432,500		
タカショー	11,900	504.000	5,997,600		
ＩＤＯＭ	26,300	1,383.000	36,372,900		
進和	5,800	2,782.000	16,135,600		
ダイトロン	3,600	3,515.000	12,654,000		
シークス	12,500	1,669.000	20,862,500		
オーハシテクニカ	4,700	1,580.000	7,426,000		
白銅	2,600	2,730.000	7,098,000		
伊藤忠商事	600,100	6,812.000	4,087,881,200		
丸紅	743,900	2,753.000	2,047,956,700		
長瀬産業	40,500	2,663.000	107,851,500		
蝶理	5,500	3,420.000	18,810,000		
豊田通商	78,200	10,105.000	790,211,000		
三共生興	14,800	740.000	10,952,000		
兼松	35,400	2,620.000	92,748,000		
三井物産	670,800	7,470.000	5,010,876,000		
日本紙パルプ商事	4,600	5,390.000	24,794,000		
カメイ	9,500	2,127.000	20,206,500		
スターゼン	6,200	2,770.000	17,174,000		
山善	26,300	1,355.000	35,636,500		
椿本興業	6,000	2,131.000	12,786,000		
住友商事	539,800	3,886.000	2,097,662,800		
内田洋行	3,500	7,080.000	24,780,000		
三菱商事	1,716,100	3,634.000	6,236,307,400		
第一実業	9,200	2,015.000	18,538,000		
キヤノンマーケティングジャパン	20,700	4,411.000	91,307,700		
西華産業	4,000	3,950.000	15,800,000		
佐藤商事	6,200	1,767.000	10,955,400		
東京産業	8,900	673.000	5,989,700		
ユアサ商事	7,300	5,650.000	41,245,000		
神鋼商事	2,300	7,020.000	16,146,000		
阪和興業	15,800	5,950.000	94,010,000		
正栄食品工業	5,900	4,515.000	26,638,500		
カナデン	6,700	1,492.000	9,996,400		
ＲＹＯＤＥＮ	7,100	2,766.000	19,638,600		
岩谷産業	20,400	9,284.000	189,393,600		
ナイス	2,600	1,761.000	4,578,600		
極東貿易	5,400	1,973.000	10,654,200		
アステナホールディングス	18,300	497.000	9,095,100		
三愛オブリ	22,200	2,081.000	46,198,200		
稲畑産業	16,900	3,205.000	54,164,500		
ＧＳＩクレオス	5,000	2,325.000	11,625,000		
明和産業	12,500	691.000	8,637,500		
ワキタ	16,100	1,573.000	25,325,300		
東邦ホールディングス	25,100	3,684.000	92,468,400		
サンゲツ	21,200	3,330.000	70,596,000		
ミツウロコグループホールディングス	12,800	1,370.000	17,536,000		
シナネンホールディングス	2,900	4,765.000	13,818,500		

伊藤忠エネクス	21,100	1,586.000	33,464,600		
サンリオ	76,200	2,842.000	216,560,400		
サンワ　テクノス	4,600	2,334.000	10,736,400		
新光商事	12,300	974.000	11,980,200		
トーホー	4,000	3,220.000	12,880,000		
三信電気	3,900	2,085.000	8,131,500		
東陽テクニカ	9,100	1,530.000	13,923,000		
モスフードサービス	12,600	3,395.000	42,777,000		
加賀電子	7,700	6,170.000	47,509,000		
ソーダニッカ	8,000	1,148.000	9,184,000		
立花エレテック	6,400	3,080.000	19,712,000		
フォーバル	1,500	1,195.000	1,792,500		
ＰＡＬＴＡＣ	13,100	4,380.000	57,378,000		
三谷産業	19,000	405.000	7,695,000		
太平洋興発	3,400	824.000	2,801,600		
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	2,300	5,760.000	13,248,000		
ＫＰＰグループホールディングス	24,800	769.000	19,071,200		
ヤマタネ	4,500	2,756.000	12,402,000		
泉州電業	4,500	5,780.000	26,010,000		
トラスコ中山	18,200	2,429.000	44,207,800		
オートバックスセブン	30,400	1,579.500	48,016,800		
モリト	7,100	1,531.000	10,870,100		
加藤産業	10,700	4,710.000	50,397,000		
イエローハット	15,000	2,048.000	30,720,000		
ＪＫホールディングス	7,800	1,083.000	8,447,400		
日伝	6,400	2,518.000	16,115,200		
杉本商事	4,300	2,227.000	9,576,100		
因幡電機産業	21,900	3,625.000	79,387,500		
東テク	9,000	3,215.000	28,935,000		
ミスミグループ本社	135,500	2,310.000	313,005,000		
タキヒヨー	3,200	1,228.000	3,929,600		
スズケン	34,300	4,511.000	154,727,300		
ジェコス	6,100	1,132.000	6,905,200		
ローソン	19,100	10,330.000	197,303,000		
サンエー	6,600	4,920.000	32,472,000		
カワチ薬品	7,000	2,674.000	18,718,000		
エービーシー・マート	39,400	3,112.000	122,612,800		
ハードオフコーポレーション	3,300	1,730.000	5,709,000		
アスクル	21,600	2,322.000	50,155,200		
ゲオホールディングス	10,300	1,971.000	20,301,300		
アダストリア	10,900	3,355.000	36,569,500		
くら寿司	10,400	5,260.000	54,704,000		
キャンドゥ	4,200	2,800.000	11,760,000		
パルグループホールディングス	17,500	1,909.000	33,407,500		
エディオン	34,700	1,661.000	57,636,700		
サーラコーポレーション	18,900	808.000	15,271,200		
ハローズ	4,000	4,700.000	18,800,000		
フジオフードグループ本社	10,200	1,405.000	14,331,000		

あみやき亭	2,400	6,620.000	15,888,000		
大黒天物産	2,800	8,680.000	24,304,000		
ハニーズホールディングス	7,200	1,731.000	12,463,200		
アルペン	7,300	2,055.000	15,001,500		
クオールホールディングス	12,400	1,780.000	22,072,000		
ジンズホールディングス	5,600	3,480.000	19,488,000		
ビックカメラ	46,400	1,644.000	76,281,600		
ＤＣＭホールディングス	49,200	1,484.000	73,012,800		
ＭｏｎｏｔａＲＯ	127,500	1,963.500	250,346,250		
ＤＤグループ	2,900	1,215.000	3,523,500		
Ｊ．フロント　リテイリング	104,200	1,655.500	172,503,100		
ドトール・日レスホールディングス	15,400	2,093.000	32,232,200		
マツキヨココカラ＆カンパニー	162,700	2,525.500	410,898,850		
ブロンコビリー	5,200	3,645.000	18,954,000		
ＺＯＺＯ	57,700	3,434.000	198,141,800		
トレジャー・ファクトリー	5,000	1,560.000	7,800,000		
物語コーポレーション	14,800	4,435.000	65,638,000		
三越伊勢丹ホールディングス	150,700	2,523.000	380,216,100		
Ｈａｍｅｅ	4,900	1,172.000	5,742,800		
ウエルシアホールディングス	46,800	2,319.500	108,552,600		
クリエイトＳＤホールディングス	13,500	3,415.000	46,102,500		
チムニー	3,500	1,329.000	4,651,500		
シュッピン	7,900	1,182.000	9,337,800		
オイシックス・ラ・大地	12,300	1,161.000	14,280,300		
ネクステージ	20,900	2,759.000	57,663,100		
ジョイフル本田	25,000	2,291.000	57,275,000		
鳥貴族ホールディングス	3,600	4,235.000	15,246,000		
ホットランド	7,100	2,188.000	15,534,800		
すかいらーくホールディングス	122,200	2,291.000	279,960,200		
ＳＦＰホールディングス	4,600	1,983.000	9,121,800		
綿半ホールディングス	5,600	1,553.000	8,696,800		
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	32,800	973.000	31,914,400		
ＢＥＥＮＯＳ	4,000	2,249.000	8,996,000		
あさひ	7,500	1,453.000	10,897,500		
日本調剤	6,400	1,562.000	9,996,800		
コスモス薬品	7,700	13,860.000	106,722,000		
セブン＆アイ・ホールディングス	913,200	2,000.000	1,826,400,000		
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	60,100	1,097.000	65,929,700		
ツルハホールディングス	18,900	10,360.000	195,804,000		
サンマルクホールディングス	7,000	2,099.000	14,693,000		
フェリシモ	4,000	914.000	3,656,000		
トリドールホールディングス	26,000	3,950.000	102,700,000		
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	11,600	295.000	3,422,000		
ＪＭホールディングス	6,900	2,722.000	18,781,800		
アレンザホールディングス	6,500	1,079.000	7,013,500		
串カツ田中ホールディングス	3,800	1,771.000	6,729,800		

クスリのアオキホールディングス	27,300	2,792.500	76,235,250		
力の源ホールディングス	4,700	1,762.000	8,281,400		
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	48,000	3,150.000	151,200,000		
メディカルシステムネットワーク	12,000	626.000	7,512,000		
ノジマ	26,900	1,846.000	49,657,400		
カッパ・クリエイト	13,700	1,589.000	21,769,300		
良品計画	98,100	2,399.500	235,390,950		
アドヴァングループ	10,500	1,061.000	11,140,500		
アルビス	2,500	2,680.000	6,700,000		
Ｇ－７ホールディングス	9,500	1,460.000	13,870,000		
イオン北海道	31,800	963.000	30,623,400		
コジマ	15,600	931.000	14,523,600		
コーナン商事	11,700	4,555.000	53,293,500		
エコス	3,600	2,315.000	8,334,000		
ワタミ	10,300	938.000	9,661,400		
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	180,700	3,933.000	710,693,100		
西松屋チェーン	17,600	2,168.000	38,156,800		
ゼンショーホールディングス	45,600	6,029.000	274,922,400		
幸楽苑ホールディングス	5,000	1,298.000	6,490,000		
サイゼリヤ	13,400	5,430.000	72,762,000		
ＶＴホールディングス	33,100	524.000	17,344,400		
フジ・コーポレーション	3,800	1,677.000	6,372,600		
ユナイテッドアローズ	10,400	1,932.000	20,092,800		
ハイデイ日高	13,100	2,876.000	37,675,600		
コロワイド	39,700	2,120.500	84,183,850		
壱番屋	34,000	1,121.000	38,114,000		
スギホールディングス	52,800	2,427.500	128,172,000		
薬王堂ホールディングス	4,600	2,809.000	12,921,400		
スクロール	13,200	940.000	12,408,000		
ヨンドシーホールディングス	7,700	1,904.000	14,660,800		
木曽路	12,800	2,471.000	31,628,800		
ＳＲＳホールディングス	14,900	1,108.000	16,509,200		
リテールパートナーズ	13,000	1,829.000	23,777,000		
上新電機	7,600	2,510.000	19,076,000		
日本瓦斯	47,500	2,632.000	125,020,000		
ロイヤルホールディングス	16,500	2,495.000	41,167,500		
いなげや	8,600	1,453.000	12,495,800		
チヨダ	9,500	883.000	8,388,500		
ライフコーポレーション	9,200	4,155.000	38,226,000		
リンガーハット	11,100	2,375.000	26,362,500		
ＭｒＭａｘＨＤ	10,700	661.000	7,072,700		
ＡＯＫＩホールディングス	18,400	1,146.000	21,086,400		
オークワ	14,400	1,051.000	15,134,400		
コメリ	13,400	3,525.000	47,235,000		
青山商事	19,500	1,651.000	32,194,500		
しまむら	21,000	7,441.000	156,261,000		

高島屋	63,500	2,354.500	149,510,750		
松屋	15,300	1,000.000	15,300,000		
エイチ・ツー・オー　リテイリング	40,900	1,955.000	79,959,500		
近鉄百貨店	4,900	2,202.000	10,789,800		
丸井グループ	60,400	2,403.500	145,171,400		
アクシアル　リテイリング	23,600	1,085.000	25,606,000		
イオン	303,300	3,331.000	1,010,292,300		
イズミ	15,900	3,726.000	59,243,400		
平和堂	14,800	2,405.000	35,594,000		
フジ	13,200	1,979.000	26,122,800		
ヤオコー	11,000	8,936.000	98,296,000		
ゼビオホールディングス	12,200	1,037.000	12,651,400		
ケーズホールディングス	61,500	1,536.500	94,494,750		
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	3,900	6,270.000	24,453,000		
ブックオフグループホールディングス	5,300	1,618.000	8,575,400		
ギフトホールディングス	3,900	3,390.000	13,221,000		
アインホールディングス	12,600	5,936.000	74,793,600		
元気寿司	5,800	3,110.000	18,038,000		
ヤマダホールディングス	288,200	473.000	136,318,600		
アークランズ	27,100	2,005.000	54,335,500		
ニトリホールディングス	32,600	23,160.000	755,016,000		
グルメ杵屋	5,900	1,091.000	6,436,900		
ケーユーホールディングス	5,900	1,140.000	6,726,000		
吉野家ホールディングス	34,000	2,900.000	98,600,000		
松屋フーズホールディングス	4,100	5,520.000	22,632,000		
サガミホールディングス	13,800	1,458.000	20,120,400		
関西フードマーケット	7,700	1,768.000	13,613,600		
王将フードサービス	6,000	7,670.000	46,020,000		
ミニストップ	6,700	1,520.000	10,184,000		
アークス	16,100	3,095.000	49,829,500		
バローホールディングス	16,900	2,494.000	42,148,600		
ベルク	4,300	7,940.000	34,142,000		
大　庄	5,500	1,256.000	6,908,000		
ファーストリテイリング	40,200	41,620.000	1,673,124,000		
サンドラッグ	30,500	4,455.000	135,877,500		
サックスバー　ホールディングス	7,700	875.000	6,737,500		
やまや	1,000	3,065.000	3,065,000		
ベルーナ	21,200	632.000	13,398,400		
いよぎんホールディングス	97,900	1,202.000	117,675,800		
しずおかフィナンシャルグループ	183,400	1,475.000	270,515,000		
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	69,000	1,313.500	90,631,500		
楽天銀行	29,300	3,420.000	100,206,000		
京都フィナンシャルグループ	104,600	2,758.000	288,486,800		
じもとホールディングス	11,000	559.000	6,149,000		
めぶきフィナンシャルグループ	405,700	555.300	225,285,210		
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10,500	4,625.000	48,562,500		
九州フィナンシャルグループ	159,400	1,096.000	174,702,400		
ゆうちょ銀行	914,700	1,574.000	1,439,737,800		

富山第一銀行	26,300	935.000	24,590,500		
コンコルディア・フィナンシャルグループ	443,300	810.800	359,427,640		
西日本フィナンシャルホールディングス	49,000	1,861.000	91,189,000		
三十三フィナンシャルグループ	7,500	2,051.000	15,382,500		
第四北越フィナンシャルグループ	12,600	4,460.000	56,196,000		
ひろぎんホールディングス	117,000	1,119.000	130,923,000		
おきなわフィナンシャルグループ	6,900	2,619.000	18,071,100		
十六フィナンシャルグループ	10,500	4,590.000	48,195,000		
北國フィナンシャルホールディングス	8,900	5,100.000	45,390,000		
プロクレアホールディングス	10,100	1,854.000	18,725,400		
あいちフィナンシャルグループ	12,000	3,275.000	39,300,000		
あおぞら銀行	60,200	2,472.000	148,814,400		
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	5,063,600	1,542.500	7,810,603,000		
りそなホールディングス	967,000	1,013.500	980,054,500		
三井住友トラスト・ホールディングス	298,600	3,291.000	982,692,600		
三井住友フィナンシャルグループ	591,200	8,937.000	5,283,554,400		
千葉銀行	229,800	1,313.500	301,842,300		
群馬銀行	158,000	886.000	139,988,000		
武蔵野銀行	10,200	2,943.000	30,018,600		
千葉興業銀行	15,600	1,099.000	17,144,400		
筑波銀行	36,200	303.000	10,968,600		
七十七銀行	24,900	4,165.000	103,708,500		
秋田銀行	4,800	2,025.000	9,720,000		
山形銀行	9,100	1,167.000	10,619,700		
岩手銀行	5,800	2,496.000	14,476,800		
東邦銀行	62,900	341.000	21,448,900		
東北銀行	4,600	1,185.000	5,451,000		
ふくおかフィナンシャルグループ	72,000	4,225.000	304,200,000		
スルガ銀行	73,600	994.000	73,158,400		
八十二銀行	173,900	1,014.500	176,421,550		
山梨中央銀行	8,900	1,800.000	16,020,000		
大垣共立銀行	15,400	2,203.000	33,926,200		
福井銀行	7,500	1,880.000	14,100,000		
清水銀行	3,600	1,581.000	5,691,600		
滋賀銀行	13,700	4,010.000	54,937,000		
南都銀行	12,300	3,035.000	37,330,500		
百五銀行	76,000	630.000	47,880,000		
紀陽銀行	28,900	1,774.000	51,268,600		
ほくほくフィナンシャルグループ	51,400	1,995.000	102,543,000		
山陰合同銀行	50,500	1,199.000	60,549,500		
鳥取銀行	3,900	1,400.000	5,460,000		
百十四銀行	7,900	2,943.000	23,249,700		
四国銀行	13,300	1,151.000	15,308,300		
阿波銀行	11,500	2,625.000	30,187,500		
大分銀行	5,100	2,915.000	14,866,500		
宮崎銀行	5,200	2,802.000	14,570,400		
佐賀銀行	5,100	2,088.000	10,648,800		
琉球銀行	19,200	1,157.000	22,214,400		

セブン銀行	267,800	283.800	76,001,640		
みずほフィナンシャルグループ	1,122,200	3,039.000	3,410,365,800		
高知銀行	2,500	965.000	2,412,500		
山口フィナンシャルグループ	80,000	1,587.500	127,000,000		
名古屋銀行	5,300	6,560.000	34,768,000		
北洋銀行	123,000	457.000	56,211,000		
大光銀行	5,300	1,448.000	7,674,400		
愛媛銀行	11,600	1,148.000	13,316,800		
トマト銀行	5,100	1,231.000	6,278,100		
京葉銀行	37,400	746.000	27,900,400		
栃木銀行	42,100	360.000	15,156,000		
北日本銀行	2,600	2,472.000	6,427,200		
東和銀行	15,200	685.000	10,412,000		
大東銀行	8,500	730.000	6,205,000		
トモニホールディングス	81,100	420.000	34,062,000		
フィデアホールディングス	8,500	1,550.000	13,175,000		
池田泉州ホールディングス	112,400	385.000	43,274,000		
ＦＰＧ	28,100	2,205.000	61,960,500		
ジャパンインベストメントアドバイザー	14,600	1,114.000	16,264,400		
ＳＢＩホールディングス	121,600	3,854.000	468,646,400		
ジャフコ　グループ	26,500	1,859.500	49,276,750		
大和証券グループ本社	641,300	1,139.500	730,761,350		
野村ホールディングス	1,398,100	957.200	1,338,261,320		
岡三証券グループ	73,400	765.000	56,151,000		
丸三証券	28,800	1,035.000	29,808,000		
東洋証券	27,400	353.000	9,672,200		
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	94,000	581.000	54,614,000		
水戸証券	23,800	466.000	11,090,800		
いちよし証券	14,800	795.000	11,766,000		
松井証券	47,400	809.000	38,346,600		
マネックスグループ	83,500	877.000	73,229,500		
極東証券	10,900	1,528.000	16,655,200		
岩井コスモホールディングス	9,400	2,226.000	20,924,400		
アイザワ証券グループ	12,200	1,223.000	14,920,600		
スパークス・グループ	9,200	1,764.000	16,228,800		
かんぽ生命保険	86,300	3,043.000	262,610,900		
ＦＰパートナー	1,700	6,020.000	10,234,000		
ＳＯＭＰＯホールディングス	375,900	3,187.000	1,197,993,300		
アニコム　ホールディングス	28,500	576.000	16,416,000		
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	557,100	2,791.000	1,554,866,100		
第一生命ホールディングス	406,000	3,652.000	1,482,712,000		
東京海上ホールディングス	821,400	4,867.000	3,997,753,800		
Ｔ＆Ｄホールディングス	224,200	2,615.000	586,283,000		
アドバンスクリエイト	6,300	1,077.000	6,785,100		
全国保証	21,600	5,416.000	116,985,600		
ジェイリース	4,800	1,243.000	5,966,400		
イントラスト	3,900	880.000	3,432,000		

日本モーゲージサービス	10,100	489.000	4,938,900		
ＳＢＩアルヒ	11,000	922.000	10,142,000		
プレミアグループ	14,200	2,058.000	29,223,600		
クレディセゾン	52,500	2,995.500	157,263,750		
芙蓉総合リース	7,400	14,160.000	104,784,000		
みずほリース	66,000	1,136.000	74,976,000		
東京センチュリー	61,700	1,639.500	101,157,150		
日本証券金融	30,900	1,620.000	50,058,000		
アイフル	130,200	532.000	69,266,400		
リコーリース	7,600	5,330.000	40,508,000		
イオンフィナンシャルサービス	47,600	1,303.500	62,046,600		
アコム	162,500	416.500	67,681,250		
ジャックス	8,600	5,570.000	47,902,000		
オリエントコーポレーション	26,800	1,064.000	28,515,200		
オリックス	500,100	3,254.000	1,627,325,400		
三菱ＨＣキャピタル	365,900	1,052.500	385,109,750		
九州リースサービス	4,800	1,357.000	6,513,600		
日本取引所グループ	215,200	4,127.000	888,130,400		
イー・ギャランティ	13,800	1,700.000	23,460,000		
アサックス	2,900	760.000	2,204,000		
ＮＥＣキャピタルソリューション	3,900	3,805.000	14,839,500		
Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ	32,000	160.000	5,120,000		
大東建託	30,500	16,800.000	512,400,000		
いちご	100,700	424.000	42,696,800		
日本駐車場開発	94,300	204.000	19,237,200		
スター・マイカ・ホールディングス	11,000	622.000	6,842,000		
ＳＲＥホールディングス	4,000	4,115.000	16,460,000		
ヒューリック	193,100	1,490.500	287,815,550		
野村不動産ホールディングス	47,300	4,290.000	202,917,000		
三重交通グループホールディングス	19,100	615.000	11,746,500		
サムティ	10,100	2,858.000	28,865,800		
ディア・ライフ	14,200	1,016.000	14,427,200		
地主	6,800	2,502.000	17,013,600		
プレサンスコーポレーション	14,600	1,746.000	25,491,600		
ＪＰＭＣ	4,500	1,322.000	5,949,000		
フージャースホールディングス	12,200	1,085.000	13,237,000		
オープンハウスグループ	30,500	4,827.000	147,223,500		
東急不動産ホールディングス	249,000	1,222.500	304,402,500		
飯田グループホールディングス	79,800	1,945.500	155,250,900		
ムゲンエステート	4,200	1,412.000	5,930,400		
シーアールイー	5,300	1,369.000	7,255,700		
ケイアイスター不動産	4,200	3,690.000	15,498,000		
グッドコムアセット	8,900	828.000	7,369,200		
ジェイ・エス・ビー	4,400	2,696.000	11,862,400		
ロードスターキャピタル	5,900	3,155.000	18,614,500		
霞ヶ関キャピタル	2,300	17,560.000	40,388,000		
パーク２４	54,500	1,808.500	98,563,250		
パラカ	3,200	1,980.000	6,336,000		

宮越ホールディングス	4,600	1,173.000	5,395,800		
三井不動産	1,152,900	1,677.000	1,933,413,300		
三菱地所	543,400	3,010.000	1,635,634,000		
平和不動産	13,900	4,095.000	56,920,500		
東京建物	72,700	2,674.000	194,399,800		
京阪神ビルディング	15,700	1,567.000	24,601,900		
住友不動産	121,000	5,936.000	718,256,000		
テーオーシー	18,100	850.000	15,385,000		
レオパレス２１	88,100	513.000	45,195,300		
スターツコーポレーション	12,500	3,475.000	43,437,500		
フジ住宅	10,800	768.000	8,294,400		
空港施設	12,000	622.000	7,464,000		
明和地所	6,200	1,002.000	6,212,400		
ゴールドクレスト	8,200	2,491.000	20,426,200		
エスリード	3,800	3,410.000	12,958,000		
日神グループホールディングス	15,200	533.000	8,101,600		
日本エスコン	16,700	1,014.000	16,933,800		
ＭＩＲＡＲＴＨホールディングス	41,900	486.000	20,363,400		
イオンモール	43,200	1,745.500	75,405,600		
毎日コムネット	6,300	800.000	5,040,000		
カチタス	22,600	1,979.000	44,725,400		
トーセイ	14,500	2,445.000	35,452,500		
穴吹興産	2,700	2,155.000	5,818,500		
サンフロンティア不動産	13,000	2,039.000	26,507,000		
ＦＪネクストホールディングス	8,800	1,341.000	11,800,800		
日本空港ビルデング	29,600	5,582.000	165,227,200		
ＬＩＦＵＬＬ	38,900	167.000	6,496,300		
ＭＩＸＩ	19,500	2,561.000	49,939,500		
ジェイエイシーリクルートメント	32,000	779.000	24,928,000		
日本M&Aセンターホールディングス	141,300	888.700	125,573,310		
メンバーズ	4,400	884.000	3,889,600		
ＵＴグループ	11,900	3,560.000	42,364,000		
アイティメディア	3,600	1,811.000	6,519,600		
ケアネット	14,700	606.000	8,908,200		
Ｅ・Ｊホールディングス	5,400	1,816.000	9,806,400		
オープンアップグループ	26,800	2,030.000	54,404,000		
コシダカホールディングス	27,700	962.000	26,647,400		
アルトナー	2,000	2,160.000	4,320,000		
パソナグループ	11,100	2,200.000	24,420,000		
リンクアンドモチベーション	26,700	508.000	13,563,600		
エス・エム・エス	31,900	2,197.500	70,100,250		
パーソルホールディングス	895,300	212.600	190,340,780		
リニカル	9,500	413.000	3,923,500		
学情	4,700	1,778.000	8,356,600		
スタジオアリス	4,800	2,010.000	9,648,000		
ＮＪＳ	2,000	3,100.000	6,200,000		
綜合警備保障	136,000	853.000	116,008,000		
カカクコム	54,000	1,799.000	97,146,000		

アイロムグループ	4,000	1,823.000	7,292,000		
セントケア・ホールディング	7,500	866.000	6,495,000		
ルネサンス	6,700	1,018.000	6,820,600		
ディップ	13,900	2,728.000	37,919,200		
デジタルホールディングス	6,000	1,139.000	6,834,000		
新日本科学	8,700	1,479.000	12,867,300		
エムスリー	172,600	1,912.000	330,011,200		
ウェルネット	12,900	557.000	7,185,300		
ワールドホールディングス	4,200	2,433.000	10,218,600		
ディー・エヌ・エー	28,000	1,536.500	43,022,000		
博報堂ＤＹホールディングス	108,300	1,426.000	154,435,800		
ぐるなび	16,000	334.000	5,344,000		
タカミヤ	14,000	549.000	7,686,000		
ファンコミュニケーションズ	15,000	409.000	6,135,000		
ライク	3,800	1,768.000	6,718,400		
エスプール	30,200	327.000	9,875,400		
ＷＤＢホールディングス	4,500	2,249.000	10,120,500		
アドウェイズ	14,300	450.000	6,435,000		
バリューコマース	8,700	1,050.000	9,135,000		
インフォマート	94,600	368.000	34,812,800		
ＪＰホールディングス	27,100	494.000	13,387,400		
プレステージ・インターナショナル	43,300	706.000	30,569,800		
アミューズ	5,300	1,597.000	8,464,100		
ドリームインキュベータ	3,200	2,346.000	7,507,200		
クイック	5,900	2,397.000	14,142,300		
電通グループ	86,200	4,229.000	364,539,800		
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,500	1,037.000	4,666,500		
ぴあ	3,100	3,095.000	9,594,500		
イオンファンタジー	3,600	2,215.000	7,974,000		
シーティーエス	10,600	747.000	7,918,200		
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	22,400	2,425.500	54,331,200		
アルプス技研	8,200	2,728.000	22,369,600		
日本空調サービス	10,200	908.000	9,261,600		
オリエンタルランド	459,700	4,771.000	2,193,228,700		
ダスキン	17,500	3,278.000	57,365,000		
明光ネットワークジャパン	13,800	716.000	9,880,800		
ファルコホールディングス	6,400	2,291.000	14,662,400		
ラウンドワン	83,400	720.000	60,048,000		
リゾートトラスト	39,000	2,660.500	103,759,500		
ビー・エム・エル	11,500	3,040.000	34,960,000		
リソー教育	50,300	277.000	13,933,100		
早稲田アカデミー	5,500	1,572.000	8,646,000		
ユー・エス・エス	197,200	1,208.000	238,217,600		
東京個別指導学院	20,000	414.000	8,280,000		
サイバーエージェント	183,000	1,047.000	191,601,000		
楽天グループ	748,300	849.800	635,905,340		
クリーク・アンド・リバー社	5,100	1,706.000	8,700,600		
ＳＢＩグローバルアセットマネジメント	18,000	717.000	12,906,000		

テー・オー・ダブリュー	33,800	376.000	12,708,800		
山田コンサルティンググループ	4,300	1,935.000	8,320,500		
セントラルスポーツ	3,700	2,458.000	9,094,600		
フルキャストホールディングス	8,800	1,438.000	12,654,400		
エン・ジャパン	15,200	2,714.000	41,252,800		
テクノプロ・ホールディングス	52,000	2,977.500	154,830,000		
アイ・アールジャパンホールディングス	5,400	1,142.000	6,166,800		
ＫｅｅＰｅｒ技研	5,600	4,160.000	23,296,000		
Ｇｕｎｏｓｙ	9,200	796.000	7,323,200		
イー・ガーディアン	4,300	1,416.000	6,088,800		
ジャパンマテリアル	27,200	2,402.000	65,334,400		
ベクトル	11,700	1,313.000	15,362,100		
チャーム・ケア・コーポレーション	7,900	1,554.000	12,276,600		
キャリアリンク	3,600	2,414.000	8,690,400		
ＩＢＪ	8,600	543.000	4,669,800		
アサンテ	5,200	1,666.000	8,663,200		
バリューＨＲ	8,000	1,325.000	10,600,000		
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	7,700	2,120.000	16,324,000		
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,200	1,035.000	7,452,000		
ＥＲＩホールディングス	2,700	2,233.000	6,029,100		
シグマクシス・ホールディングス	12,300	1,673.000	20,577,900		
ウィルグループ	7,000	1,076.000	7,532,000		
メドピア	9,400	669.000	6,288,600		
レアジョブ	4,000	727.000	2,908,000		
リクルートホールディングス	643,100	6,775.000	4,357,002,500		
エラン	12,000	927.000	11,124,000		
日本郵政	1,023,300	1,490.500	1,525,228,650		
ベルシステム２４ホールディングス	11,300	1,577.000	17,820,100		
鎌倉新書	9,900	524.000	5,187,600		
エアトリ	7,200	1,450.000	10,440,000		
アトラエ	7,800	444.000	3,463,200		
ストライク	3,900	4,905.000	19,129,500		
ソラスト	25,400	511.000	12,979,400		
セラク	5,300	1,082.000	5,734,600		
インソース	20,100	777.000	15,617,700		
ベイカレント・コンサルティング	64,500	3,453.000	222,718,500		
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	2,700	954.000	2,575,800		
アイモバイル	14,100	391.000	5,513,100		
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	4,000	1,214.000	4,856,000		
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	28,800	2,294.000	66,067,200		
グリーンズ	2,300	2,209.000	5,080,700		
エル・ティー・エス	1,300	2,282.000	2,966,600		
ミダックホールディングス	5,700	1,508.000	8,595,600		
キュービーネットホールディングス	5,900	1,171.000	6,908,900		
ＲＰＡホールディングス	17,300	277.000	4,792,100		
マネジメントソリューションズ	4,000	1,730.000	6,920,000		
フロンティア・マネジメント	2,600	1,583.000	4,115,800		

コプロ・ホールディングス	1,600	1,613.000	2,580,800	
アンビスホールディングス	9,700	2,461.000	23,871,700	
カーブスホールディングス	24,400	783.000	19,105,200	
フォーラムエンジニアリング	13,000	896.000	11,648,000	
ＦＡＳＴ　ＦＩＴＮＥＳＳ　ＪＡＰＡＮ	4,100	1,101.000	4,514,100	
ダイレクトマーケティングミックス	13,800	258.000	3,560,400	
ポピンズ	3,500	1,304.000	4,564,000	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	7,200	1,895.000	13,644,000	
リログループ	45,700	1,348.000	61,603,600	
東祥	10,900	716.000	7,804,400	
ＩＤ＆Ｅ　ホールディングス	5,600	4,560.000	25,536,000	
ビーウィズ	2,400	2,099.000	5,037,600	
ＴＲＥホールディングス	17,900	1,222.000	21,873,800	
人・夢・技術グループ	3,600	1,731.000	6,231,600	
ＮＩＳＳＯホールディングス	9,000	840.000	7,560,000	
大栄環境	16,400	2,568.000	42,115,200	
日本管財ホールディングス	8,900	2,565.000	22,828,500	
M&A総研ホールディングス	4,300	5,370.000	23,091,000	
エイチ・アイ・エス	26,600	1,904.000	50,646,400	
ラックランド	4,100	2,010.000	8,241,000	
共立メンテナンス	28,600	3,346.000	95,695,600	
イチネンホールディングス	9,100	1,718.000	15,633,800	
建設技術研究所	4,600	4,490.000	20,654,000	
スペース	7,100	1,033.000	7,334,300	
燦ホールディングス	8,500	1,065.000	9,052,500	
スバル興業	4,000	2,815.000	11,260,000	
東京テアトル	8,500	1,107.000	9,409,500	
ナガワ	2,900	7,200.000	20,880,000	
東京都競馬	7,600	4,350.000	33,060,000	
カナモト	14,400	2,721.000	39,182,400	
ニシオホールディングス	8,300	3,815.000	31,664,500	
トランス・コスモス	11,300	3,185.000	35,990,500	
乃村工藝社	40,100	868.000	34,806,800	
藤田観光	3,800	7,330.000	27,854,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	6,100	1,266.000	7,722,600	
トーカイ	7,600	2,127.000	16,165,200	
白洋舎	1,300	2,634.000	3,424,200	
セコム	88,600	10,900.000	965,740,000	
セントラル警備保障	5,000	2,666.000	13,330,000	
丹青社	18,200	920.000	16,744,000	
メイテックグループホールディングス	32,500	2,912.500	94,656,250	
応用地質	8,700	2,453.000	21,341,100	
船井総研ホールディングス	18,500	2,400.000	44,400,000	
いであ	3,200	2,275.000	7,280,000	
学究社	4,200	2,112.000	8,870,400	
イオンディライト	9,700	3,765.000	36,520,500	
ダイセキ	18,100	3,090.000	55,929,000	
ステップ	3,200	1,955.000	6,256,000	

合　計	135,763,000		328,904,326,020	

(b)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

国内債券パッシブ・マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

	（2024年4月15日現在）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	8,877,261
コール・ローン	419,400,751
国債証券	106,015,357,050
地方債証券	8,571,473,300
特殊債券	10,329,625,931
社債券	7,036,495,400
未収入金	8,000,000
未収利息	213,282,758
前払費用	7,143,361
流動資産合計	132,609,655,812
資産合計	132,609,655,812
負債の部	
流動負債	
未払金	18,383,100
未払解約金	1,340,000
流動負債合計	19,723,100
負債合計	19,723,100
純資産の部	
元本等	
元本	110,417,739,877
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	22,172,192,835
元本等合計	132,589,932,712
純資産合計	132,589,932,712
負債純資産合計	132,609,655,812

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2023年4月14日 至 2024年4月15日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	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。

	(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。 (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。 (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。

（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	（2024年4月15日現在）
１．　当計算期間の末日における受益権の総数	110,417,739,877口
２．　１単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　1.2008円 （１万口当たりの純資産額12,008円）

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	自 2023年4月14日 至 2024年4月15日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

３． 金融商品に係るリスク管理体制	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。 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、上下限値、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。 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。

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	（2024年4月15日現在）
１． 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２． 時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
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 2023年4月14日 至 2024年4月15日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

（2024年4月15日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	97,440,897,328円
同期中における追加設定元本額	32,921,633,392円
同期中における一部解約元本額	19,944,790,843円
2024年4月15日現在の元本の内訳	
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	9,933,579,119円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	15,945,388,626円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	4,219,685,760円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	959,076,907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）	192,213,002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）	645,690,749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）	1,286,889,880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）	723,109,470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）	890,257,855円
三井住友・ＤＣ年金バランスゼロ（債券型）	136,451,522円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	815,309,218円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	240,763,225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ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	118,835,350円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	5,167,568,819円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	1,806,616,658円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	3,010,170,808円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	730,168,131円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	85,283,917円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	343,704,950円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	450,683,761円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	956,911,485円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	323,451,603円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	11,886,895円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５	83,804,325円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０	37,235,207円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５	30,298,733円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５	4,353,994円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５	2,389,503円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型）	6,683,740円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型）	61,695,718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）	164,608,113円

三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型）	55,431,437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）	5,359,401円
ＳＭＡＭ・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	1,026,606,427円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	8,392,501,943円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	5,893,045,157円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	15,411,886,549円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	316,393,567円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	518,203,029円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	274,074,334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＞	118,270,332円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜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＞	7,494,699,749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）	877,152,362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＞	184,730,732円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	53,193,797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＞	1,953,422,683円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	564,366,626円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	224,885,881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＞	247,874,507円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	4,568,708,466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＞	1,150,803,238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＞	762,553,316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＞	1,215,896,913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Ⅱ＜適格機関投資家限定＞	919,043,400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＞	708,375,673円
合　計	110,417,739,877円

（３）附属明細表

①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	４５３　２年国債	50,000,000	49,890,500	
	４５４　２年国債	60,000,000	59,930,400	
	４５５　２年国債	1,030,000,000	1,026,734,900	
	４５６　２年国債	230,000,000	229,528,500	

４５７　２年国債	500,000,000	498,745,000	
４５８　２年国債	180,000,000	179,814,600	
４５９　２年国債	240,000,000	239,671,200	
１４５　５年国債	1,180,000,000	1,179,315,600	
１４６　５年国債	1,000,000,000	998,240,000	
１４７　５年国債	1,310,000,000	1,303,843,000	
１４８　５年国債	1,180,000,000	1,173,344,800	
１４９　５年国債	1,290,000,000	1,281,744,000	
１５０　５年国債	3,130,000,000	3,107,495,300	
１５１　５年国債	300,000,000	297,561,000	
１５２　５年国債	730,000,000	726,079,900	
１５３　５年国債	1,200,000,000	1,188,852,000	
１５４　５年国債	1,180,000,000	1,171,185,400	
１５６　５年国債	1,280,000,000	1,273,484,800	
１５７　５年国債	370,000,000	367,565,400	
１５８　５年国債	980,000,000	969,759,000	
１５９　５年国債	100,000,000	98,828,000	
１６０　５年国債	1,190,000,000	1,180,944,100	
１６１　５年国債	370,000,000	368,705,000	
１６２　５年国債	220,000,000	218,851,600	
１６３　５年国債	770,000,000	769,330,100	
１６４　５年国債	280,000,000	276,726,800	
１６５　５年国債	1,510,000,000	1,499,263,900	
１６６　５年国債	440,000,000	438,988,000	
１　４０年国債	40,000,000	45,030,000	
２　４０年国債	242,000,000	262,265,080	
３　４０年国債	185,000,000	199,846,250	
４　４０年国債	247,000,000	265,880,680	
５　４０年国債	235,000,000	242,158,100	
６　４０年国債	240,000,000	241,351,200	
７　４０年国債	265,000,000	253,435,400	
８　４０年国債	300,000,000	265,098,000	
９　４０年国債	523,000,000	335,133,170	
１０　４０年国債	470,000,000	353,665,600	
１１　４０年国債	370,000,000	266,522,100	
１２　４０年国債	390,000,000	247,798,200	
１３　４０年国債	515,000,000	322,493,000	
１４　４０年国債	525,000,000	350,962,500	
１５　４０年国債	560,000,000	412,529,600	
１６　４０年国債	480,000,000	386,572,800	
３４０　１０年国債	570,000,000	572,114,700	
３４１　１０年国債	557,000,000	557,885,630	
３４２　１０年国債	350,000,000	348,992,000	
３４３　１０年国債	310,000,000	308,890,200	
３４４　１０年国債	811,000,000	807,666,790	

３４５　１０年国債	258,000,000	256,797,720	
３４６　１０年国債	340,000,000	338,174,200	
３４７　１０年国債	100,000,000	99,370,000	
３４８　１０年国債	145,000,000	143,916,850	
３４９　１０年国債	650,000,000	644,325,500	
３５０　１０年国債	510,000,000	504,670,500	
３５１　１０年国債	350,000,000	345,898,000	
３５２　１０年国債	150,000,000	147,912,000	
３５３　１０年国債	180,000,000	177,111,000	
３５４　１０年国債	565,000,000	554,796,100	
３５５　１０年国債	660,000,000	647,163,000	
３５６　１０年国債	130,000,000	127,318,100	
３５７　１０年国債	730,000,000	713,867,000	
３５８　１０年国債	1,010,000,000	985,891,300	
３５９　１０年国債	1,130,000,000	1,100,269,700	
３６０　１０年国債	1,150,000,000	1,116,811,000	
３６１　１０年国債	1,160,000,000	1,123,471,600	
３６２　１０年国債	1,110,000,000	1,072,371,000	
３６３　１０年国債	1,030,000,000	992,508,000	
３６４　１０年国債	980,000,000	941,456,600	
３６５　１０年国債	1,040,000,000	995,966,400	
３６６　１０年国債	1,170,000,000	1,126,066,500	
３６７　１０年国債	1,110,000,000	1,065,000,600	
３６８　１０年国債	1,190,000,000	1,138,556,300	
３６９　１０年国債	1,110,000,000	1,086,934,200	
３７０　１０年国債	1,070,000,000	1,045,432,800	
３７１　１０年国債	1,010,000,000	975,447,900	
３７２　１０年国債	970,000,000	969,146,400	
３７３　１０年国債	1,140,000,000	1,115,501,400	
２　３０年国債	440,000,000	488,061,200	
４　３０年国債	340,000,000	391,112,200	
５　３０年国債	290,000,000	321,897,100	
７　３０年国債	474,000,000	533,515,440	
９　３０年国債	240,000,000	253,123,200	
１０　３０年国債	95,000,000	97,740,750	
１１　３０年国債	430,000,000	464,675,200	
１２　３０年国債	570,000,000	636,650,100	
１４　３０年国債	392,000,000	449,467,200	
１６　３０年国債	205,000,000	237,519,150	
１８　３０年国債	190,000,000	216,676,000	
１９　３０年国債	170,000,000	194,072,000	
２１　３０年国債	345,000,000	394,169,400	
２２　３０年国債	315,000,000	367,302,600	
２３　３０年国債	349,000,000	407,153,870	
２４　３０年国債	460,000,000	536,875,200	

２５　３０年国債	260,000,000	297,364,600	
２６　３０年国債	253,000,000	292,204,880	
２７　３０年国債	250,000,000	291,807,500	
２８　３０年国債	96,000,000	112,027,200	
２９　３０年国債	157,000,000	180,840,450	
３０　３０年国債	142,000,000	161,465,360	
３１　３０年国債	235,000,000	263,366,850	
３２　３０年国債	360,000,000	407,768,400	
３３　３０年国債	208,000,000	226,027,360	
３４　３０年国債	87,000,000	96,854,490	
３５　３０年国債	260,000,000	280,675,200	
３６　３０年国債	90,000,000	96,904,800	
３７　３０年国債	225,000,000	237,993,750	
３８　３０年国債	220,000,000	228,382,000	
３９　３０年国債	220,000,000	231,723,800	
４０　３０年国債	260,000,000	268,702,200	
４１　３０年国債	240,000,000	243,408,000	
４２　３０年国債	280,000,000	283,374,000	
４３　３０年国債	265,000,000	267,612,900	
４４　３０年国債	310,000,000	312,607,100	
４５　３０年国債	315,000,000	306,296,550	
４６　３０年国債	315,000,000	305,745,300	
４７　３０年国債	290,000,000	286,151,700	
４８　３０年国債	400,000,000	379,956,000	
４９　３０年国債	345,000,000	327,049,650	
５０　３０年国債	325,000,000	271,979,500	
５１　３０年国債	345,000,000	256,072,800	
５２　３０年国債	363,000,000	281,742,450	
５３　３０年国債	297,000,000	235,057,680	
５４　３０年国債	115,000,000	94,949,750	
５５　３０年国債	355,000,000	292,161,450	
５６　３０年国債	320,000,000	262,505,600	
５７　３０年国債	325,000,000	265,746,000	
５８　３０年国債	350,000,000	285,029,500	
５９　３０年国債	390,000,000	308,880,000	
６０　３０年国債	380,000,000	314,754,000	
６１　３０年国債	345,000,000	271,114,800	
６２　３０年国債	275,000,000	204,344,250	
６３　３０年国債	230,000,000	165,466,600	
６４　３０年国債	315,000,000	225,480,150	
６５　３０年国債	275,000,000	196,025,500	
６６　３０年国債	360,000,000	255,333,600	
６７　３０年国債	410,000,000	306,372,500	
６８　３０年国債	360,000,000	267,760,800	
６９　３０年国債	350,000,000	266,668,500	

７０　３０年国債	370,000,000	280,900,300	
７１　３０年国債	350,000,000	264,757,500	
７２　３０年国債	370,000,000	278,872,700	
７３　３０年国債	380,000,000	285,376,200	
７４　３０年国債	380,000,000	309,137,600	
７５　３０年国債	360,000,000	315,720,000	
７６　３０年国債	370,000,000	331,867,800	
７７　３０年国債	350,000,000	328,674,500	
７８　３０年国債	400,000,000	357,656,000	
７９　３０年国債	320,000,000	272,076,800	
８０　３０年国債	360,000,000	353,538,000	
８１　３０年国債	380,000,000	355,664,800	
８２　３０年国債	10,000,000	9,790,500	
８２　２０年国債	620,000,000	637,384,800	
８４　２０年国債	500,000,000	515,020,000	
８５　２０年国債	645,000,000	667,936,200	
８８　２０年国債	742,000,000	774,781,560	
８９　２０年国債	20,000,000	20,840,200	
９０　２０年国債	580,000,000	607,097,600	
９２　２０年国債	324,000,000	339,772,320	
９３　２０年国債	632,000,000	663,543,120	
９５　２０年国債	305,000,000	324,303,450	
９７　２０年国債	327,000,000	347,973,780	
９９　２０年国債	153,000,000	162,844,020	
１００　２０年国債	207,000,000	221,744,610	
１０１　２０年国債	355,000,000	383,034,350	
１０２　２０年国債	457,000,000	495,168,640	
１０５　２０年国債	370,000,000	397,291,200	
１０６　２０年国債	370,000,000	398,900,700	
１０７　２０年国債	378,000,000	406,769,580	
１０９　２０年国債	40,000,000	42,764,000	
１１１　２０年国債	386,000,000	419,859,920	
１１３　２０年国債	27,000,000	29,337,930	
１１４　２０年国債	163,000,000	177,647,180	
１１８　２０年国債	200,000,000	217,782,000	
１１９　２０年国債	295,000,000	317,697,300	
１２０　２０年国債	200,000,000	212,928,000	
１２１　２０年国債	55,000,000	59,648,050	
１２２　２０年国債	130,000,000	140,179,000	
１２３　２０年国債	70,000,000	76,940,500	
１２５　２０年国債	205,000,000	227,263,000	
１２６　２０年国債	180,000,000	197,083,800	
１２７　２０年国債	145,000,000	157,796,250	
１２８　２０年国債	65,000,000	70,838,950	
１３０　２０年国債	155,000,000	167,990,550	

１３１　２０年国債	80,000,000	86,136,800	
１３２　２０年国債	450,000,000	484,735,500	
１３３　２０年国債	190,000,000	206,056,900	
１３４　２０年国債	200,000,000	217,172,000	
１３５　２０年国債	155,000,000	167,077,600	
１３６　２０年国債	120,000,000	128,446,800	
１３７　２０年国債	185,000,000	199,541,000	
１３９　２０年国債	60,000,000	64,226,400	
１４０　２０年国債	420,000,000	453,251,400	
１４１　２０年国債	360,000,000	388,659,600	
１４２　２０年国債	240,000,000	261,172,800	
１４３　２０年国債	150,000,000	160,800,000	
１４４　２０年国債	170,000,000	180,740,600	
１４５　２０年国債	110,000,000	118,870,400	
１４６　２０年国債	195,000,000	210,757,950	
１４７　２０年国債	840,000,000	899,959,200	
１４８　２０年国債	459,000,000	486,976,050	
１４９　２０年国債	625,000,000	662,743,750	
１５０　２０年国債	571,000,000	599,361,570	
１５１　２０年国債	700,000,000	719,754,000	
１５２　２０年国債	540,000,000	554,455,800	
１５３　２０年国債	587,000,000	608,067,430	
１５４　２０年国債	650,000,000	665,379,000	
１５５　２０年国債	510,000,000	510,000,000	
１５６　２０年国債	270,000,000	251,264,700	
１５７　２０年国債	385,000,000	348,159,350	
１５８　２０年国債	380,000,000	355,262,000	
１５９　２０年国債	388,000,000	365,798,640	
１６０　２０年国債	445,000,000	423,177,200	
１６１　２０年国債	610,000,000	570,624,500	
１６２　２０年国債	530,000,000	493,790,400	
１６３　２０年国債	520,000,000	482,487,200	
１６４　２０年国債	545,000,000	496,516,800	
１６５　２０年国債	600,000,000	543,834,000	
１６６　２０年国債	495,000,000	459,468,900	
１６７　２０年国債	530,000,000	475,680,300	
１６８　２０年国債	520,000,000	457,490,800	
１６９　２０年国債	480,000,000	413,385,600	
１７０　２０年国債	385,000,000	329,794,850	
１７１　２０年国債	475,000,000	404,695,250	
１７２　２０年国債	480,000,000	413,716,800	
１７３　２０年国債	495,000,000	424,388,250	
１７４　２０年国債	700,000,000	596,925,000	
１７５　２０年国債	685,000,000	591,244,050	
１７６　２０年国債	670,000,000	575,282,100	

	１７７　２０年国債	670,000,000	562,418,100	
	１７８　２０年国債	650,000,000	552,545,500	
	１７９　２０年国債	690,000,000	583,788,300	
	１８０　２０年国債	550,000,000	489,043,500	
	１８１　２０年国債	590,000,000	531,837,800	
	１８２　２０年国債	550,000,000	511,582,500	
	１８３　２０年国債	540,000,000	526,737,600	
	１８４　２０年国債	590,000,000	545,160,000	
	１８５　２０年国債	590,000,000	543,513,900	
	１８６　２０年国債	480,000,000	472,180,800	
	１８７　２０年国債	410,000,000	388,393,000	
	国債証券　小計		106,015,357,050	
地方債証券	１　東京都３０年	100,000,000	111,925,200	
	８　東京都３０年	400,000,000	446,814,400	
	１３　東京都３０年	500,000,000	526,572,000	
	６　東京都２０年	100,000,000	101,695,800	
	２６－１５　北海道公債	100,000,000	100,230,700	
	３０－１８　北海道公債	200,000,000	196,190,600	
	２１０　神奈川県公債	100,000,000	100,224,200	
	２１１　神奈川県公債	100,000,000	100,214,000	
	３　神奈川県２０年	100,000,000	102,278,900	
	７　神奈川県２０年	100,000,000	105,407,000	
	１３　神奈川県２０年	100,000,000	109,188,700	
	３８８　大阪府公債	100,000,000	100,202,100	
	３９２　大阪府公債	100,000,000	100,173,000	
	１　大阪府２０年	200,000,000	217,407,400	
	１７９　大阪府５年	100,000,000	99,473,200	
	１９３　大阪府５年	300,000,000	296,810,400	
	２７－４　京都府公債	100,000,000	100,442,000	
	２９－４　京都府公債	100,000,000	99,427,300	
	１－６　京都府５年	200,000,000	199,918,800	
	５　兵庫県公債１５年	300,000,000	310,562,400	
	１０兵庫県公債２０年	100,000,000	109,549,200	
	７　静岡県３０年	100,000,000	105,400,000	
	１　静岡県２０年	100,000,000	102,807,400	
	２２－８　愛知県２０年	200,000,000	215,830,400	
	２７－１６　愛知県公債	400,000,000	401,194,800	
	２　埼玉県公債	300,000,000	296,162,400	
	５　埼玉県２０年	100,000,000	107,427,500	
	２６－１０　福岡県公債	100,000,000	100,260,400	
	１－１　福岡県公債	200,000,000	194,620,800	
	１－３　福岡県３０年	100,000,000	71,136,100	
	２６－４　千葉県公債	100,000,000	100,201,800	
	２７－３　千葉県公債	100,000,000	100,411,200	
	２８－１　千葉県公債	100,000,000	99,463,700	

	９　千葉県２０年	200,000,000	215,279,000	
	１３８　共同発行地方	200,000,000	200,403,600	
	１５５　共同発行地方	100,000,000	99,831,100	
	１７２　共同発行地方	500,000,000	497,544,000	
	１８３　共同発行地方	600,000,000	593,902,200	
	１９９　共同発行地方	100,000,000	97,228,500	
	３　名古屋市２０年	100,000,000	102,189,500	
	５　名古屋市２０年	100,000,000	104,728,300	
	１　京都市３０年	100,000,000	116,405,400	
	７　京都市２０年	100,000,000	108,289,600	
	２６－１７　神戸市公債	100,000,000	100,103,500	
	４　横浜市２０年	100,000,000	101,725,400	
	７　横浜市２０年	100,000,000	102,996,000	
	９　横浜市２０年	100,000,000	104,354,700	
	１４　横浜市２０年	100,000,000	107,307,600	
	２－７　札幌市公債	100,000,000	96,499,600	
	９４　川崎市公債	100,000,000	95,574,800	
	１－２　北九州市５年	100,000,000	99,956,600	
	１－２　岡山県公債	100,000,000	97,530,100	
	地方債証券　小計		8,571,473,300	
特殊債券	４７日本政策投資ＣＯ	100,000,000	102,074,700	
	１２４　日本政策投資	100,000,000	96,944,100	
	３６　日本政策投資Ｂ	100,000,000	105,510,800	
	１８　道路機構	100,000,000	118,938,600	
	２２　道路機構	300,000,000	345,501,000	
	２７　道路機構	100,000,000	106,484,700	
	３７　道路機構	300,000,000	323,429,400	
	４７　道路機構	200,000,000	217,601,400	
	１３５　道路機構	200,000,000	203,069,800	
	７４　政保道路機構	100,000,000	106,596,100	
	７９　政保道路機構	200,000,000	215,624,000	
	８１　政保道路機構	200,000,000	215,842,200	
	８８　政保道路機構	100,000,000	112,700,400	
	９０　政保道路機構	500,000,000	541,990,500	
	９９　政保道路機構	100,000,000	109,378,000	
	１２７　政保道路機構	200,000,000	218,058,600	
	１７６　政保道路機構	100,000,000	106,991,500	
	１９６　政保道路機構	100,000,000	108,220,500	
	２１０　政保道路機構	200,000,000	212,032,000	
	２２７　政保道路機構	200,000,000	200,423,800	
	２３１　政保道路機構	300,000,000	300,729,900	
	２８８　政保道路機構	189,000,000	187,553,205	
	９　道路債券	100,000,000	115,870,300	
	２　地方公営２０年	100,000,000	107,724,100	
	４　地方公共団２０年	100,000,000	107,655,900	

１８　地方公共団２０	300,000,000	319,082,700	
Ｆ９６　地方公共団体	100,000,000	102,792,200	
Ｆ１４３地方公共団体	100,000,000	102,613,300	
６４　地方公共団体	100,000,000	100,133,300	
６７政保地方公共団	100,000,000	100,243,600	
７６政保地方公共団	300,000,000	300,996,300	
８５　地方公共団体	100,000,000	99,036,100	
１０１　地方公共団体	100,000,000	98,800,800	
１０６　地方公共団体	200,000,000	196,849,000	
２９　地方公共団５年	300,000,000	296,490,900	
１５　公営企業２０年	100,000,000	102,520,000	
１７　公営企業２０年	100,000,000	103,634,800	
２０　公営企業２０年	100,000,000	104,979,300	
２２　公営企業２０年	100,000,000	105,562,700	
２４　公営企業２０年	200,000,000	213,231,800	
１０　日本政策金融	100,000,000	108,693,500	
８９　都市再生	100,000,000	102,349,400	
９３　都市再生	100,000,000	102,362,900	
１１７　都市再生	100,000,000	100,455,100	
３３　政保中部空港	200,000,000	198,765,600	
５２　住宅支援機構	100,000,000	108,018,200	
９３　住宅支援機構	100,000,000	103,001,600	
１２４　住宅支援機構	100,000,000	103,422,600	
１３０　住宅支援機構	200,000,000	214,071,600	
２２６　住宅支援機構	100,000,000	99,092,100	
Ｓ１１　住宅機構ＲＭＢＳ	10,496,000	10,568,422	
１９　住宅機構ＲＭＢＳ	12,767,000	13,111,709	
２４　住宅機構ＲＭＢＳ	25,716,000	26,520,910	
２６　住宅機構ＲＭＢＳ	39,867,000	41,094,903	
２７　住宅機構ＲＭＢＳ	14,376,000	14,882,035	
２８　住宅機構ＲＭＢＳ	16,665,000	17,354,931	
２９　住宅機構ＲＭＢＳ	18,022,000	18,800,550	
３０　住宅機構ＲＭＢＳ	17,612,000	18,374,599	
３２　住宅機構ＲＭＢＳ	34,968,000	36,282,796	
３５　住宅機構ＲＭＢＳ	17,742,000	18,451,680	
３６　住宅機構ＲＭＢＳ	16,935,000	17,554,821	
４３　住宅機構ＲＭＢＳ	22,055,000	22,778,404	
４６　住宅機構ＲＭＢＳ	16,916,000	17,528,359	
４８　住宅機構ＲＭＢＳ	32,172,000	33,323,757	
４９　住宅機構ＲＭＢＳ	16,420,000	16,956,934	
５１　住宅機構ＲＭＢＳ	35,856,000	36,978,292	
５５　住宅機構ＲＭＢＳ	48,054,000	49,240,933	
５７　住宅機構ＲＭＢＳ	22,950,000	23,546,700	
５８　住宅機構ＲＭＢＳ	25,634,000	26,269,723	
５９　住宅機構ＲＭＢＳ	48,816,000	50,114,505	

	６０　住宅機構ＲＭＢＳ	73,938,000	75,579,423	
	６１　住宅機構ＲＭＢＳ	24,923,000	25,386,567	
	６７　住宅機構ＲＭＢＳ	32,042,000	32,237,456	
	６９　住宅機構ＲＭＢＳ	66,928,000	67,972,076	
	７０　住宅機構ＲＭＢＳ	57,960,000	58,974,300	
	７３　住宅機構ＲＭＢＳ	32,852,000	33,426,910	
	９９　住宅機構ＲＭＢＳ	51,971,000	51,160,252	
	１２３　住宅機構ＲＭＢＳ	69,453,000	65,660,866	
	１２４　住宅機構ＲＭＢＳ	69,031,000	65,047,911	
	１２５　住宅機構ＲＭＢＳ	68,825,000	64,860,680	
	１２７　住宅機構ＲＭＢＳ	71,025,000	66,678,270	
	１２８　住宅機構ＲＭＢＳ	69,669,000	65,572,462	
	１２９　住宅機構ＲＭＢＳ	71,404,000	67,298,270	
	１３７　住宅機構ＲＭＢＳ	73,821,000	69,369,593	
	１６７　住宅機構ＲＭＢＳ	86,078,000	79,449,994	
	１８３　住宅機構ＲＭＢＳ	184,414,000	172,795,918	
	１８６　住宅機構ＲＭＢＳ	93,735,000	89,554,419	
	１９８　住宅機構ＲＭＢＳ	196,280,000	195,926,696	
	８５　中日本高速道	300,000,000	298,794,000	
	特殊債券　小計		10,329,625,931	
社債券	８６　東日本高速道	200,000,000	197,810,800	
	２３　西日本高速道	100,000,000	100,183,400	
	８４　西日本高速道	200,000,000	198,987,600	
	１３　大和ハウス	100,000,000	99,114,400	
	１７　アサヒグループＨＤ	200,000,000	198,271,800	
	３０　東レ	100,000,000	99,237,900	
	１２　旭化成	200,000,000	194,191,000	
	２４三菱ケミカルホールデイ	100,000,000	98,731,800	
	３２　住友電工	100,000,000	98,374,300	
	１６　小松製作所	100,000,000	98,620,400	
	２２　日立製作所	100,000,000	99,921,900	
	９　ＴＤＫ	100,000,000	97,220,000	
	６３　三井物産	100,000,000	105,522,200	
	８　みずほコーポレート	100,000,000	106,364,300	
	１　三井住友ＦＧ劣後	100,000,000	100,174,300	
	８　住友信託　劣後	100,000,000	104,966,200	
	１　みずほＦＧ劣後	100,000,000	100,232,200	
	９　みずほ銀行劣後	100,000,000	105,164,500	
	１７　ＮＴＴファイナンス	200,000,000	197,765,400	
	７３　ホンダファイナンス	200,000,000	197,887,400	
	１０１　トヨタファイナンス	200,000,000	199,432,200	
	２０７　オリツクス	200,000,000	198,197,600	
	２　三菱ＨＣキヤピタル	200,000,000	197,591,600	
	５８　三菱地所	100,000,000	114,290,000	
	１３５　三菱地所	200,000,000	190,160,800	

	１０　東急	100,000,000	94,385,100	
	３８　京王電鉄	100,000,000	99,079,600	
	１１０東日本旅客鉄	100,000,000	97,317,700	
	１６９　東日本旅客鉄	200,000,000	190,003,800	
	６０　西日本旅客鉄	200,000,000	193,887,200	
	４１　東海旅客鉄道	100,000,000	106,827,400	
	４２　東海旅客鉄道	100,000,000	107,772,200	
	４５　東京地下鉄	100,000,000	96,365,500	
	６４　阪急阪神ＨＬＤＧ	100,000,000	98,934,900	
	１５　九州旅客鉄道	200,000,000	197,875,400	
	３１　ＫＤＤＩ	200,000,000	198,678,800	
	５４６　中部電力	200,000,000	189,838,400	
	５５３　中部電力	200,000,000	198,548,000	
	５５０　関西電力	300,000,000	298,299,900	
	５６０　関西電力	200,000,000	202,547,200	
	５０８　東北電力	200,000,000	196,647,800	
	５４７　東北電力	100,000,000	98,318,400	
	４９６　九州電力	300,000,000	284,097,900	
	５６　東京電力ＰＧ	200,000,000	200,873,000	
	６６　東京電力ＰＧ	100,000,000	98,128,200	
	４１　大阪瓦斯	200,000,000	190,806,000	
	７　フアーストリテイリング	100,000,000	98,849,000	
	社債券　小計		7,036,495,400	
合　計			131,952,951,681	

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

（１）貸借対照表

（単位：円）

	（2024年4月15日現在）
資産の部	
流動資産	
預金	11,486,014,386
金銭信託	91,083,076
コール・ローン	4,303,164,083
株式	714,616,318,545
投資証券	13,991,445,940
派生商品評価勘定	32,279,393
未収入金	35,085,226
未収配当金	816,048,380
差入委託証拠金	6,678,831,837
流動資産合計	752,050,270,866
資産合計	752,050,270,866
負債の部	

流動負債	
派生商品評価勘定	315,437,020
未払解約金	195,556,504
流動負債合計	510,993,524
負債合計	510,993,524
純資産の部	
元本等	
元本	86,028,877,355
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	665,510,399,987
元本等合計	751,539,277,342
純資産合計	751,539,277,342
負債純資産合計	752,050,270,866

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2023年4月14日 至 2024年4月15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。 (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。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
２．　デリバティブの評価基準及び評価方法	(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。 (2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項　目	（2024年4月15日現在）
１．　当計算期間の末日における受益権の総数	86,028,877,355口
２．　１単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　8.7359円 （１万口当たりの純資産額87,359円）

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	自 2023年4月14日 至 2024年4月15日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、投資証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

３． 金融商品に係るリスク管理体制	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。 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、上下限値、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。 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。

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	（2024年4月15日現在）
１． 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２． 時価の算定方法	(1) 有価証券（株式、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
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）

（2024年4月15日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区　分	種　類	契　約　額　等	うち１年超	時　価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建				
	S&P 500 EMINI FUT JUN24	18,226,142,651	-	17,961,553,058	△264,589,593
	SPI 200 FUTURES JUN24	677,914,834	-	679,839,353	1,924,519
	FTSE 100 IDX FUT JUN24	917,521,912	-	934,561,023	17,039,111
	EURO STOXX 50 JUN24	3,247,735,132	-	3,202,640,000	△45,095,132
	小計	23,069,314,529	-	22,778,593,434	△290,721,095
合　計		23,069,314,529	-	22,778,593,434	△290,721,095

（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	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	3,175,376,235	-	3,185,828,994	10,452,759
	カナダ・ドル	105,311,599	-	105,082,922	△228,677
	オーストラリア・ドル	75,499,551	-	75,382,589	△116,962
	香港・ドル	48,617,345	-	48,768,050	150,705
	イギリス・ポンド	146,249,474	-	145,825,857	△423,617
	スイス・フラン	76,678,360	-	76,894,994	216,634
	デンマーク・クローネ	49,809,466	-	49,532,597	△276,869
	スウェーデン・クローナ	53,832,921	-	53,348,460	△484,461
	ユーロ	336,816,586	-	335,090,544	△1,726,042
	小計	4,068,191,537	-	4,075,755,007	7,563,470
合　計		4,068,191,537	-	4,075,755,007	7,563,470

（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。

①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。

②計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

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

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 2023年4月14日 至 2024年4月15日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

（2024年4月15日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	76,203,741,596円
同期中における追加設定元本額	17,488,943,225円
同期中における一部解約元本額	7,663,807,466円
2024年4月15日現在の元本の内訳	
三井住友・ＤＣ外国株式インデックスファンドＳ	42,990,449,191円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	259,516,324円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	1,014,337,922円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	790,689,390円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	51,995,739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）	765,630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）	3,601,783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）	12,813,474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）	40,360,721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）	50,605,421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）	106,594,763円
外国株式指数ファンド	1,104,457,663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	22,948,754,654円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	97,657,956円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	137,067,823円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	80,159,909円
イオン・バランス戦略ファンド	42,243,343円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	28,309,935円

三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	134,784,484円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	131,356,484円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	517,652,045円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	322,723,868円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	455,022,352円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	62,972,472円
三井住友ＤＳ・外国株式インデックス年金ファンド	2,712,756,878円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	11,347,322円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	56,486,726円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	58,835,062円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	2,867,568円
ＳＭＢＣ・ＤＣインデックスファンド（ＭＳＣＩコクサイ）	1,571,757,760円
日興ＦＷＳ・先進国株インデックス（為替ヘッジあり）	173,899,280円
日興ＦＷＳ・先進国株インデックス（為替ヘッジなし）	3,104,736,236円
三井住友ＤＳ・先進国株式インデックス・ファンド	143,517,868円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５	3,219,128円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０	1,998,744円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５	2,901,574円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５	1,038,604円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５	575,165円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型）	99,917円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型）	2,713,567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）	14,290,406円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型）	10,233,639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）	4,243,187円
ＳＭＡＭ・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	279,917,840円
バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	2,242,785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＞	9,723,824円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	286,791,688円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	500,874,652円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	2,262,715,546円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	7,175,685円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	35,454,474円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	366,150,876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＞	25,858,474円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	61,384,367円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	315,853,251円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	210,761,650円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	455,656,445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）	171,888,008円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	40,990,345円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜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＞	5,129,340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＞	10,907,735円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	35,828,808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＞	75,035,068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＞	123,840,880円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	43,169,103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＞	1,227,538,371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＞	24,547,544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＞	20,159,599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Ⅱ＜適格機関投資家限定＞	62,948,484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＞	52,011,227円
合　計	86,028,877,355円

（３）附属明細表

①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	27,608	33.720	930,941.76	
	BAKER HUGHES CO	78,082	33.050	2,580,610.10	
	CHENIERE ENERGY INC	19,829	156.790	3,108,988.91	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	7,695	88.590	681,700.05	
	CHEVRON CORP	143,891	158.960	22,872,913.36	
	CONOCOPHILLIPS	95,633	131.200	12,547,049.60	
	COTERRA ENERGY INC	59,741	27.640	1,651,241.24	
	DEVON ENERGY CORP	49,897	53.420	2,665,497.74	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,065	206.340	2,695,832.10	
	EOG RESOURCES INC	47,111	135.290	6,373,647.19	
	EQT CORP	33,522	37.250	1,248,694.50	
	EXXON MOBIL CORP	319,361	120.370	38,441,483.57	
	HALLIBURTON CO	67,581	39.670	2,680,938.27	
	HESS CORP	21,198	153.210	3,247,745.58	
	HF SINCLAIR CORP	10,663	60.000	639,780.00	
	KINDER MORGAN INC	156,197	18.130	2,831,851.61	
	MARATHON OIL CORP	42,380	29.090	1,232,834.20	
	MARATHON PETROLEUM CORP	31,150	208.770	6,503,185.50	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	51,961	69.010	3,585,828.61	
	ONEOK INC	47,832	78.700	3,764,378.40	
	OVINTIV INC	23,075	53.740	1,240,050.50	
	PHILLIPS 66	36,059	162.490	5,859,226.91	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	18,987	270.800	5,141,679.60	
	SCHLUMBERGER LTD	114,141	52.000	5,935,332.00	
	TARGA RESOURCES CORP	15,416	114.690	1,768,061.04	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	1,251	605.720	757,755.72	
	VALERO ENERGY CORP	26,805	173.540	4,651,739.70	

WILLIAMS COS INC	97,204	38.080	3,701,528.32	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	18,025	231.530	4,173,328.25	
ALBEMARLE CORP	8,338	122.580	1,022,072.04	
AMCOR PLC	122,899	8.910	1,095,030.09	
AVERY DENNISON CORP	6,759	211.230	1,427,703.57	
BALL CORP	23,469	65.520	1,537,688.88	
CELANESE CORP	8,742	156.040	1,364,101.68	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	14,020	78.100	1,094,962.00	
CLEVELAND-CLIFFS INC	47,180	21.640	1,020,975.20	
CORTEVA INC	53,900	53.760	2,897,664.00	
CROWN HOLDINGS INC	9,413	77.310	727,719.03	
DOW INC	53,862	57.690	3,107,298.78	
DUPONT DE NEMOURS INC	36,397	73.800	2,686,098.60	
EASTMAN CHEMICAL CO	9,517	97.980	932,475.66	
ECOLAB INC	20,862	221.690	4,624,896.78	
FMC CORP	8,548	56.750	485,099.00	
FREEPORT-MCMORAN INC	113,312	49.470	5,605,544.64	
INTERNATIONAL PAPER CO	23,472	37.140	871,750.08	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	20,983	83.610	1,754,388.63	
LINDE PLC	38,572	447.410	17,257,498.52	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	22,165	101.530	2,250,412.45	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,759	602.110	2,865,441.49	
MOSAIC CO/THE	25,489	31.120	793,217.68	
NEWMONT CORP	94,978	38.640	3,669,949.92	
NUCOR CORP	18,997	194.530	3,695,486.41	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,111	182.200	1,295,624.20	
PPG INDUSTRIES INC	18,754	134.430	2,521,100.22	
RELIANCE INC	5,040	325.530	1,640,671.20	
RPM INTERNATIONAL INC	10,397	108.450	1,127,554.65	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19,206	318.250	6,112,309.50	
STEEL DYNAMICS INC	12,713	140.630	1,787,829.19	
VULCAN MATERIALS CO	11,015	262.780	2,894,521.70	
WESTLAKE CORP	2,189	153.460	335,923.94	
WESTROCK CO	23,379	47.990	1,121,958.21	
3M CO	42,482	91.310	3,879,031.42	
AECOM	10,261	93.610	960,532.21	
AERCAP HOLDINGS NV	17,564	83.020	1,458,163.28	
ALLEGION PLC	6,843	127.420	871,935.06	
AMETEK INC	18,518	179.710	3,327,869.78	
AXON ENTERPRISE INC	5,927	310.810	1,842,170.87	
BOEING CO/THE	45,164	169.550	7,657,556.20	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	9,801	189.530	1,857,583.53	
CARLISLE COS INC	3,499	373.140	1,305,616.86	
CARRIER GLOBAL CORP	66,639	56.840	3,787,760.76	

CATERPILLAR INC	40,207	365.630	14,700,885.41	
CNH INDUSTRIAL NV	87,561	12.630	1,105,895.43	
CUMMINS INC	11,429	298.630	3,413,042.27	
DEERE & CO	21,624	397.270	8,590,566.48	
DOVER CORP	10,436	172.060	1,795,618.16	
EATON CORP PLC	31,946	318.500	10,174,801.00	
EMERSON ELECTRIC CO	45,278	112.650	5,100,566.70	
FASTENAL CO	47,002	70.450	3,311,290.90	
FERGUSON PLC	16,077	216.320	3,477,776.64	
FORTIVE CORP	29,388	82.410	2,421,865.08	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	10,648	77.560	825,858.88	
GE VERNOVA INC	21,971	134.000	2,944,114.00	
GENERAL DYNAMICS CORP	19,052	287.870	5,484,499.24	
GENERAL ELECTRIC CO	87,887	154.630	13,589,966.81	
GRACO INC	15,068	89.470	1,348,133.96	
HEICO CORP	3,085	191.760	591,579.60	
HEICO CORP-CLASS A	6,593	156.030	1,028,705.79	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	52,330	196.160	10,265,052.80	
HOWMET AEROSPACE INC	33,070	64.000	2,116,480.00	
HUBBELL INC	3,897	401.740	1,565,580.78	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,888	275.720	796,279.36	
IDEX CORP	6,048	232.670	1,407,188.16	
ILLINOIS TOOL WORKS	24,584	253.510	6,232,289.84	
INGERSOLL-RAND INC	33,421	91.920	3,072,058.32	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	11,600	36.450	422,820.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	52,470	65.290	3,425,766.30	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	15,814	202.620	3,204,232.68	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,750	471.160	1,295,690.00	
LOCKHEED MARTIN CORP	17,925	450.400	8,073,420.00	
MASCO CORP	19,187	73.550	1,411,203.85	
NORDSON CORP	3,927	264.650	1,039,280.55	
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,636	456.110	5,307,295.96	
OTIS WORLDWIDE CORP	31,838	96.160	3,061,542.08	
OWENS CORNING	7,597	165.510	1,257,379.47	
PACCAR INC	43,068	118.160	5,088,914.88	
PARKER HANNIFIN CORP	10,389	550.320	5,717,274.48	
PENTAIR PLC	11,509	81.100	933,379.90	
QUANTA SERVICES INC	11,797	254.690	3,004,577.93	
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,678	284.820	2,471,667.96	
RTX CORP	114,716	100.100	11,483,071.60	
SMITH (A.O.) CORP	10,652	86.500	921,398.00	
SNAP-ON INC	4,041	289.580	1,170,192.78	
STANLEY BLACK & DECKER INC	10,869	91.480	994,296.12	
TEXTRON INC	14,870	93.960	1,397,185.20	

TORO CO	8,097	85.770	694,479.69	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,510	296.960	5,496,729.60	
TRANSDIGM GROUP INC	4,470	1,220.380	5,455,098.60	
UNITED RENTALS INC	5,383	674.810	3,632,502.23	
VERTIV HOLDINGS CO-A	28,880	83.890	2,422,743.20	
WABTEC CORP	15,150	146.180	2,214,627.00	
WATSCO INC	2,364	417.710	987,466.44	
WW GRAINGER INC	3,504	964.970	3,381,254.88	
XYLEM INC	19,463	128.110	2,493,404.93	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	33,429	243.850	8,151,661.65	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	10,637	144.090	1,532,685.33	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	8,963	198.830	1,782,113.29	
CINTAS CORP	7,515	668.410	5,023,101.15	
COPART INC	67,779	55.380	3,753,601.02	
DAYFORCE INC	10,485	60.640	635,810.40	
EQUIFAX INC	10,373	246.990	2,562,027.27	
JACOBS SOLUTIONS INC	10,393	144.650	1,503,347.45	
LEIDOS HOLDINGS INC	11,403	125.730	1,433,699.19	
PAYCHEX INC	24,917	123.000	3,064,791.00	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,778	198.000	748,044.00	
PAYLOCITY HOLDING CORP	2,718	168.070	456,814.26	
REPUBLIC SERVICES INC	17,805	187.820	3,344,135.10	
ROBERT HALF INC	8,149	72.070	587,298.43	
ROLLINS INC	25,137	44.350	1,114,825.95	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,314	62.010	1,197,661.14	
TRANSUNION	14,503	73.570	1,066,985.71	
VERALTO CORP	17,640	87.370	1,541,206.80	
VERISK ANALYTICS INC	11,354	222.530	2,526,605.62	
WASTE CONNECTIONS INC	20,167	167.120	3,370,309.04	
WASTE MANAGEMENT INC	31,845	205.370	6,540,007.65	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,726	70.480	615,008.48	
CSX CORP	154,835	35.340	5,471,868.90	
DELTA AIR LINES INC	14,192	46.860	665,037.12	
EXPEDITORS INTL WASH INC	10,436	117.650	1,227,795.40	
FEDEX CORP	19,408	267.800	5,197,462.40	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	159,485	3.330	531,085.05	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	6,308	185.470	1,169,944.76	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	12,089	51.000	616,539.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	18,442	245.740	4,531,937.08	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	15,354	221.130	3,395,230.02	
SOUTHWEST AIRLINES CO	14,057	27.540	387,129.78	
UBER TECHNOLOGIES INC	149,788	75.280	11,276,040.64	
U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING	5,850	62.100	363,285.00	
UNION PACIFIC CORP	48,339	234.400	11,330,661.60	

UNITED PARCEL SERVICE-CL B	57,939	144.910	8,395,940.49	
APTIV PLC	21,117	74.190	1,566,670.23	
BORGWARNER INC	17,433	33.500	584,005.50	
FORD MOTOR CO	325,996	12.610	4,110,809.56	
GENERAL MOTORS CO	112,023	43.080	4,825,950.84	
LEAR CORP	3,736	133.700	499,503.20	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	45,698	9.130	417,222.74	
TESLA INC	228,609	171.050	39,103,569.45	
DECKERS OUTDOOR CORP	2,220	814.370	1,807,901.40	
DR HORTON INC	24,030	151.710	3,645,591.30	
GARMIN LTD	13,282	143.110	1,900,787.02	
HASBRO INC	11,407	55.800	636,510.60	
LENNAR CORP-A	19,331	159.900	3,091,026.90	
LULULEMON ATHLETICA INC	9,037	336.130	3,037,606.81	
NIKE INC -CL B	97,809	92.000	8,998,428.00	
NVR INC	250	7,817.980	1,954,495.00	
PULTEGROUP INC	17,535	110.890	1,944,456.15	
AIRBNB INC-CLASS A	35,805	159.370	5,706,242.85	
BOOKING HOLDINGS INC	2,816	3,531.800	9,945,548.80	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	15,881	40.100	636,828.10	
CARNIVAL CORP	84,815	14.360	1,217,943.40	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,228	2,957.600	6,589,532.80	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,323	153.050	1,426,885.15	
DOMINO'S PIZZA INC	2,875	495.310	1,424,016.25	
DOORDASH INC - A	20,142	138.380	2,787,249.96	
DRAFTKINGS INC-CL A	32,265	44.220	1,426,758.30	
EXPEDIA GROUP INC	10,081	130.460	1,315,167.26	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	20,092	205.100	4,120,869.20	
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,371	152.750	514,920.25	
LAS VEGAS SANDS CORP	27,977	50.430	1,410,880.11	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	19,665	251.060	4,937,094.90	
MCDONALD'S CORP	57,912	267.390	15,485,089.68	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,198	42.480	942,971.04	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	19,234	127.670	2,455,604.78	
STARBUCKS CORP	91,761	84.920	7,792,344.12	
VAIL RESORTS INC	2,860	226.970	649,134.20	
WYNN RESORTS LTD	7,730	101.180	782,121.40	
YUM! BRANDS INC	22,535	137.800	3,105,323.00	
AMAZON.COM INC	743,977	186.130	138,476,439.01	
AUTOZONE INC	1,423	2,962.320	4,215,381.36	
BATH & BODY WORKS INC	15,400	45.220	696,388.00	
BEST BUY CO INC	14,954	78.000	1,166,412.00	
BURLINGTON STORES INC	4,802	190.110	912,908.22	
CARMAX INC	14,212	71.410	1,014,878.92	

DICK'S SPORTING GOODS INC	4,406	203.130	894,990.78	
EBAY INC	40,534	51.310	2,079,799.54	
ETSY INC	9,090	67.050	609,484.50	
GENUINE PARTS CO	10,245	145.380	1,489,418.10	
GLOBAL-E ONLINE LTD	5,491	34.430	189,055.13	
HOME DEPOT INC	79,203	342.870	27,156,332.61	
LKQ CORP	18,982	49.250	934,863.50	
LOWE'S COS INC	46,096	232.050	10,696,576.80	
MERCADOLIBRE INC	3,632	1,444.140	5,245,116.48	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,881	1,076.490	5,254,347.69	
POOL CORP	3,252	380.200	1,236,410.40	
ROSS STORES INC	26,967	135.990	3,667,242.33	
TJX COMPANIES INC	91,584	94.420	8,647,361.28	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,071	244.890	1,976,507.19	
ULTA BEAUTY INC	3,734	442.320	1,651,622.88	
WILLIAMS-SONOMA INC	5,476	288.850	1,581,742.60	
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	31,907	20.380	650,264.66	
COSTCO WHOLESALE CORP	35,569	731.310	26,011,965.39	
DOLLAR GENERAL CORP	18,277	147.780	2,700,975.06	
DOLLAR TREE INC	15,923	125.190	1,993,400.37	
KROGER CO	56,767	55.200	3,133,538.40	
SYSCO CORP	39,957	75.250	3,006,764.25	
TARGET CORP	36,380	166.120	6,043,445.60	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	52,808	17.850	942,622.80	
WALMART INC	352,461	60.140	21,197,004.54	
ALTRIA GROUP INC	143,314	41.050	5,883,039.70	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	42,289	60.970	2,578,360.33	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	22,643	49.430	1,119,243.49	
BUNGE GLOBAL SA	12,343	103.770	1,280,833.11	
CAMPBELL SOUP CO	12,945	42.310	547,702.95	
CELSIUS HOLDINGS INC	11,375	79.720	906,815.00	
COCA-COLA CO/THE	326,114	58.280	19,005,923.92	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	18,105	67.740	1,226,432.70	
CONAGRA BRANDS INC	39,722	29.310	1,164,251.82	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,701	262.240	3,330,710.24	
DARLING INGREDIENTS INC	10,514	44.390	466,716.46	
GENERAL MILLS INC	46,029	66.200	3,047,119.80	
HERSHEY CO/THE	12,733	185.800	2,365,791.40	
HORMEL FOODS CORP	25,536	33.930	866,436.48	
JM SMUCKER CO/THE	8,172	109.610	895,732.92	
KELLANOVA	19,503	55.420	1,080,856.26	
KEURIG DR PEPPER INC	80,434	30.220	2,430,715.48	
KRAFT HEINZ CO/THE	71,746	35.940	2,578,551.24	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	10,534	79.770	840,297.18	

MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,425	71.760	1,322,178.00	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	16,433	66.340	1,090,165.22	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	110,679	66.690	7,381,182.51	
MONSTER BEVERAGE CORP	60,052	55.010	3,303,460.52	
PEPSICO INC	109,192	168.100	18,355,175.20	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	125,615	88.850	11,160,892.75	
TYSON FOODS INC-CL A	25,497	57.780	1,473,216.66	
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,954	101.080	2,016,950.32	
CLOROX COMPANY	9,104	141.980	1,292,585.92	
COLGATE-PALMOLIVE CO	63,558	85.850	5,456,454.30	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	19,241	138.800	2,670,650.80	
KENVUE INC	136,817	19.130	2,617,309.21	
KIMBERLY-CLARK CORP	28,172	123.890	3,490,229.08	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	189,216	155.330	29,390,921.28	
ABBOTT LABORATORIES	137,987	109.110	15,055,761.57	
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,703	314.970	1,796,273.91	
BAXTER INTERNATIONAL INC	39,241	40.330	1,582,589.53	
BECTON DICKINSON AND CO	22,525	235.170	5,297,204.25	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	119,191	68.070	8,113,331.37	
CARDINAL HEALTH INC	20,986	105.100	2,205,628.60	
CENCORA INC	13,560	234.000	3,173,040.00	
CENTENE CORP	44,436	70.730	3,142,958.28	
COOPER COS INC/THE	17,340	93.520	1,621,636.80	
CVS HEALTH CORP	104,686	68.640	7,185,647.04	
DAVITA INC	4,138	130.420	539,677.96	
DEXCOM INC	30,245	136.140	4,117,554.30	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	47,943	90.280	4,328,294.04	
ELEVANCE HEALTH INC	18,843	497.490	9,374,204.07	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	31,160	86.280	2,688,484.80	
HCA HEALTHCARE INC	16,132	322.820	5,207,732.24	
HENRY SCHEIN INC	10,457	71.010	742,551.57	
HOLOGIC INC	19,730	77.330	1,525,720.90	
HUMANA INC	9,498	312.590	2,968,979.82	
IDEXX LABORATORIES INC	6,610	497.790	3,290,391.90	
INSULET CORP	5,082	175.220	890,468.04	
INTUITIVE SURGICAL INC	28,058	384.800	10,796,718.40	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	6,245	205.730	1,284,783.85	
MCKESSON CORP	10,903	523.010	5,702,378.03	
MEDTRONIC PLC	106,507	80.130	8,534,405.91	
MOLINA HEALTHCARE INC	4,673	376.570	1,759,711.61	
QUEST DIAGNOSTICS INC	9,647	128.530	1,239,928.91	
RESMED INC	12,536	185.860	2,329,940.96	
SOLVENTUM CORP	10,620	62.750	666,405.00	
STERIS PLC	7,525	204.000	1,535,100.00	

STRYKER CORP	27,336	342.050	9,350,278.80	
TELEFLEX INC	3,067	214.440	657,687.48	
THE CIGNA GROUP	23,734	349.840	8,303,102.56	
UNITEDHEALTH GROUP INC	74,182	439.200	32,580,734.40	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,203	166.790	701,018.37	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12,279	206.740	2,538,560.46	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,537	124.480	1,934,045.76	
ABBVIE INC	141,866	162.280	23,022,014.48	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	23,121	140.730	3,253,818.33	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,171	148.500	1,361,893.50	
AMGEN INC	42,647	267.280	11,398,690.16	
AVANTOR INC	56,039	24.960	1,398,733.44	
BIOGEN INC	11,114	198.180	2,202,572.52	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	13,832	92.220	1,275,587.04	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,728	300.450	519,177.60	
BIO-TECHNE CORP	13,296	66.730	887,242.08	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	165,115	48.280	7,971,752.20	
CATALENT INC	16,025	56.300	902,207.50	
CHARLES RIVER LABORATORIES	3,467	241.340	836,725.78	
DANAHER CORP	55,838	239.950	13,398,328.10	
ELI LILLY & CO	64,661	751.640	48,601,794.04	
EXACT SCIENCES CORP	13,570	71.340	968,083.80	
GILEAD SCIENCES INC	101,504	68.070	6,909,377.28	
ILLUMINA INC	11,573	127.070	1,470,581.11	
INCYTE CORP	15,899	53.850	856,161.15	
IQVIA HOLDINGS INC	14,439	234.230	3,382,046.97	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,089	110.580	452,161.62	
JOHNSON & JOHNSON	193,233	147.520	28,505,732.16	
MERCK & CO. INC.	203,578	125.740	25,597,897.72	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,691	1,261.070	2,132,469.37	
MODERNA INC	27,369	105.140	2,877,576.66	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,744	134.660	1,177,467.04	
PFIZER INC	450,002	25.860	11,637,051.72	
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,559	904.700	7,743,327.30	
REPLIGEN CORP	3,456	171.530	592,807.68	
REVVITY INC	10,411	103.490	1,077,434.39	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	27,162	28.220	766,511.64	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	92,472	13.300	1,229,877.60	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	30,671	565.230	17,336,169.33	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,537	232.590	822,670.83	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,919	396.550	8,295,429.45	
VIATRIS INC	83,466	11.330	945,669.78	
WATERS CORP	5,084	322.660	1,640,403.44	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	6,204	380.000	2,357,520.00	

ZOETIS INC	36,026	149.980	5,403,179.48	
BANK OF AMERICA CORP	567,727	35.790	20,318,949.33	
CITIGROUP INC	150,445	59.680	8,978,557.60	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	36,122	33.140	1,197,083.08	
FIFTH THIRD BANCORP	58,586	34.530	2,022,974.58	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	845	1,569.170	1,325,948.65	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	105,007	13.310	1,397,643.17	
JPMORGAN CHASE & CO	231,777	182.790	42,366,517.83	
KEYCORP	84,828	14.610	1,239,337.08	
M & T BANK CORP	12,629	134.560	1,699,358.24	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	32,800	150.630	4,940,664.00	
REGIONS FINANCIAL CORP	79,089	19.190	1,517,717.91	
TRUIST FINANCIAL CORP	110,627	36.770	4,067,754.79	
US BANCORP	124,161	41.580	5,162,614.38	
WELLS FARGO & CO	291,035	56.470	16,434,746.45	
ALLY FINANCIAL INC	20,139	37.230	749,774.97	
AMERICAN EXPRESS CO	47,234	218.200	10,306,458.80	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,978	413.700	3,300,498.60	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	31,181	110.130	3,433,963.53	
ARES MANAGEMENT CORP - A	13,891	131.350	1,824,582.85	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	61,100	55.050	3,363,555.00	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	105,086	403.260	42,376,980.36	
BLACKROCK INC	11,942	763.400	9,116,522.80	
BLACKSTONE INC	57,022	123.470	7,040,506.34	
BLOCK INC	43,616	76.990	3,357,995.84	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	29,775	139.620	4,157,185.50	
CARLYLE GROUP INC/THE	16,730	45.790	766,066.70	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9,059	178.510	1,617,122.09	
CME GROUP INC	28,301	209.500	5,929,059.50	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	13,634	245.750	3,350,555.50	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	19,925	26.780	533,591.50	
CORPAY INC	6,278	299.910	1,882,834.98	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	18,645	120.910	2,254,366.95	
EQUITABLE HOLDINGS INC	22,820	36.500	832,930.00	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,946	426.240	1,255,703.04	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	47,604	70.950	3,377,503.80	
FISERV INC	46,955	151.200	7,099,596.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	21,778	25.410	553,378.98	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	6,533	57.490	375,582.17	
GLOBAL PAYMENTS INC	20,594	123.740	2,548,301.56	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	26,343	389.490	10,260,335.07	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	46,756	133.550	6,244,263.80	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,971	167.570	832,990.47	
KKR & CO INC	45,385	97.290	4,415,506.65	

LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	6,164	261.120	1,609,543.68	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,653	213.000	565,089.00	
MASTERCARD INC - A	66,608	465.380	30,998,031.04	
MOODY'S CORP	13,390	377.160	5,050,172.40	
MORGAN STANLEY	96,914	86.190	8,353,017.66	
MSCI INC	6,223	526.620	3,277,156.26	
NASDAQ INC	27,999	61.520	1,722,498.48	
NORTHERN TRUST CORP	16,793	83.830	1,407,757.19	
PAYPAL HOLDINGS INC	80,330	64.590	5,188,514.70	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	17,112	122.550	2,097,075.60	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	31,965	17.970	574,411.05	
S&P GLOBAL INC	25,973	417.810	10,851,779.13	
SCHWAB (CHARLES) CORP	122,498	70.030	8,578,534.94	
SEI INVESTMENTS COMPANY	7,550	67.480	509,474.00	
STATE STREET CORP	25,474	75.780	1,930,419.72	
SYNCHRONY FINANCIAL	32,112	40.410	1,297,645.92	
T ROWE PRICE GROUP INC	17,303	115.190	1,993,132.57	
TOAST INC-CLASS A	21,393	23.820	509,581.26	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	8,688	102.130	887,305.44	
VISA INC-CLASS A SHARES	126,723	275.960	34,970,479.08	
AFLAC INC	44,628	80.280	3,582,735.84	
ALLSTATE CORP	20,503	166.810	3,420,105.43	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,866	127.310	619,490.46	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	55,264	73.680	4,071,851.52	
AON PLC-CLASS A	15,769	308.000	4,856,852.00	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,061	89.980	2,614,908.78	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,577	234.580	3,888,632.66	
ASSURANT INC	4,977	174.190	866,943.63	
BROWN & BROWN INC	18,424	81.900	1,508,925.60	
CHUBB LTD	32,924	245.810	8,093,048.44	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	13,251	118.620	1,571,833.62	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,244	381.150	855,300.60	
EVEREST GROUP LTD	3,547	361.810	1,283,340.07	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	19,058	48.610	926,409.38	
GLOBE LIFE INC	6,373	59.090	376,580.57	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	25,592	97.780	2,502,385.76	
LOEWS CORP	16,971	73.900	1,254,156.90	
MARKEL GROUP INC	957	1,432.540	1,370,940.78	
MARSH & MCLENNAN COS	39,623	198.070	7,848,127.61	
METLIFE INC	52,395	70.140	3,674,985.30	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	19,458	79.820	1,553,137.56	
PROGRESSIVE CORP	46,866	203.900	9,555,977.40	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	28,865	109.690	3,166,201.85	
TRAVELERS COS INC/THE	18,256	221.100	4,036,401.60	

WILLIS TOWERS WATSON PLC	7,897	260.310	2,055,668.07	
WR BERKLEY CORP	18,153	82.150	1,491,268.95	
ACCENTURE PLC-CL A	50,124	315.400	15,809,109.60	
ADOBE INC	35,884	474.090	17,012,245.56	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	13,226	103.470	1,368,494.22	
ANSYS INC	6,763	334.200	2,260,194.60	
APPLOVIN CORP-CLASS A	15,026	75.570	1,135,514.82	
ASPEN TECHNOLOGY INC	1,901	211.490	402,042.49	
ATLASSIAN CORP-CL A	12,421	206.530	2,565,309.13	
AUTODESK INC	17,384	236.980	4,119,660.32	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	18,166	48.170	875,056.22	
BILL HOLDINGS INC	6,004	61.660	370,206.64	
CADENCE DESIGN SYS INC	21,421	305.850	6,551,612.85	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	7,561	161.730	1,222,840.53	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	22,962	93.760	2,152,917.12	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	41,604	69.260	2,881,493.04	
CONFLUENT INC-CLASS A	15,954	28.560	455,646.24	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	17,817	309.050	5,506,343.85	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,173	248.430	788,268.39	
DATADOG INC - CLASS A	22,908	127.510	2,920,999.08	
DOCUSIGN INC	17,164	58.900	1,010,959.60	
DROPBOX INC-CLASS A	16,584	22.990	381,266.16	
DYNATRACE INC	21,256	45.850	974,587.60	
EPAM SYSTEMS INC	4,815	259.160	1,247,855.40	
FAIR ISAAC CORP	1,871	1,175.610	2,199,566.31	
FORTINET INC	52,961	66.450	3,519,258.45	
GARTNER INC	6,179	465.450	2,876,015.55	
GEN DIGITAL INC	41,779	20.930	874,434.47	
GODADDY INC - CLASS A	11,895	123.300	1,466,653.50	
HUBSPOT INC	3,878	663.350	2,572,471.30	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	72,539	182.270	13,221,683.53	
INTUIT INC	22,300	621.110	13,850,753.00	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	4,648	237.810	1,105,340.88	
MICROSOFT CORP	564,526	421.900	238,173,519.40	
MONDAY.COM LTD	2,382	193.110	459,988.02	
MONGODB INC	5,921	352.060	2,084,547.26	
OKTA INC	13,914	98.260	1,367,189.64	
ORACLE CORP	131,791	121.110	15,961,208.01	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	146,227	22.670	3,314,966.09	
PALO ALTO NETWORKS INC	25,644	279.070	7,156,471.08	
PTC INC	9,246	180.060	1,664,834.76	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,664	535.830	4,642,431.12	
SALESFORCE INC	77,348	294.320	22,765,063.36	
SAMSARA INC-CL A	13,749	31.880	438,318.12	

SERVICENOW INC	16,283	768.710	12,516,904.93	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	21,974	158.560	3,484,197.44	
SYNOPSYS INC	12,237	557.160	6,817,966.92	
TWILIO INC - A	15,028	60.850	914,453.80	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,139	413.360	1,297,537.04	
UIPATH INC - CLASS A	25,298	20.710	523,921.58	
UNITY SOFTWARE INC	19,066	25.310	482,560.46	
VERISIGN INC	7,316	185.430	1,356,605.88	
WIX.COM LTD	5,348	127.140	679,944.72	
WORKDAY INC-CLASS A	16,772	263.690	4,422,608.68	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	18,307	61.630	1,128,260.41	
ZSCALER INC	7,508	181.410	1,362,026.28	
AMPHENOL CORP-CL A	48,323	113.320	5,475,962.36	
APPLE INC	1,174,480	176.550	207,354,444.00	
ARISTA NETWORKS INC	21,651	271.220	5,872,184.22	
CDW CORP/DE	10,704	242.910	2,600,108.64	
CISCO SYSTEMS INC	322,103	48.490	15,618,774.47	
CORNING INC	64,764	31.490	2,039,418.36	
DELL TECHNOLOGIES -C	18,797	117.760	2,213,534.72	
F5 INC	3,921	187.990	737,108.79	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	102,647	17.420	1,788,110.74	
HP INC	75,219	28.530	2,145,998.07	
JABIL INC	9,808	134.070	1,314,958.56	
JUNIPER NETWORKS INC	21,151	36.650	775,184.15	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	13,320	155.100	2,065,932.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,784	343.810	4,395,267.04	
NETAPP INC	17,045	101.810	1,735,351.45	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	15,879	85.190	1,352,732.01	
SUPER MICRO COMPUTER INC	4,017	898.490	3,609,234.33	
TE CONNECTIVITY LTD	25,716	142.980	3,676,873.68	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,432	398.480	1,367,583.36	
TRIMBLE INC	20,783	60.540	1,258,202.82	
WESTERN DIGITAL CORP	24,533	72.055	1,767,725.31	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,189	289.680	1,213,469.52	
ADVANCED MICRO DEVICES	129,086	163.280	21,077,162.08	
ANALOG DEVICES INC	38,973	192.270	7,493,338.71	
APPLIED MATERIALS INC	65,931	207.860	13,704,417.66	
BROADCOM INC	35,646	1,344.070	47,910,719.22	
ENPHASE ENERGY INC	10,381	117.020	1,214,784.62	
ENTEGRIS INC	12,569	132.870	1,670,043.03	
FIRST SOLAR INC	8,882	182.480	1,620,787.36	
INTEL CORP	333,261	35.690	11,894,085.09	
KLA CORP	11,071	680.780	7,536,915.38	
LAM RESEARCH CORP	10,683	957.040	10,224,058.32	

LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	11,073	74.760	827,817.48	
MARVELL TECHNOLOGY INC	70,092	70.160	4,917,654.72	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	44,600	85.640	3,819,544.00	
MICRON TECHNOLOGY INC	88,208	122.520	10,807,244.16	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	4,028	658.230	2,651,350.44	
NVIDIA CORP	197,544	881.860	174,206,151.84	
NXP SEMICONDUCTORS NV	20,596	233.610	4,811,431.56	
ON SEMICONDUCTOR	35,773	66.640	2,383,912.72	
QORVO INC	7,835	111.360	872,505.60	
QUALCOMM INC	89,333	171.290	15,301,849.57	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,506	101.550	1,371,534.30	
TERADYNE INC	10,642	105.870	1,126,668.54	
TEXAS INSTRUMENTS INC	72,570	166.330	12,070,568.10	
AT&T INC	571,612	16.310	9,322,991.72	
LIBERTY GLOBAL LTD-C	21,079	17.310	364,877.49	
T-MOBILE US INC	40,664	160.050	6,508,273.20	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	334,763	39.720	13,296,786.36	
AES CORP	54,086	16.850	911,349.10	
ALLIANT ENERGY CORP	21,204	48.000	1,017,792.00	
AMEREN CORPORATION	19,979	71.760	1,433,693.04	
AMERICAN ELECTRIC POWER	43,705	82.100	3,588,180.50	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,191	116.570	1,770,814.87	
ATMOS ENERGY CORP	10,802	113.990	1,231,319.98	
CENTERPOINT ENERGY INC	54,717	27.460	1,502,528.82	
CMS ENERGY CORP	23,541	57.660	1,357,374.06	
CONSOLIDATED EDISON INC	28,772	88.630	2,550,062.36	
CONSTELLATION ENERGY	25,008	191.670	4,793,283.36	
DOMINION ENERGY INC	66,086	48.910	3,232,266.26	
DTE ENERGY COMPANY	16,277	106.250	1,729,431.25	
DUKE ENERGY CORP	62,251	94.900	5,907,619.90	
EDISON INTERNATIONAL	32,299	68.630	2,216,680.37	
ENTERGY CORP	17,246	102.910	1,774,785.86	
ESSENTIAL UTILITIES INC	16,329	34.360	561,064.44	
EVERGY INC	17,275	50.950	880,161.25	
EVERSOURCE ENERGY	25,375	58.790	1,491,796.25	
EXELON CORP	76,292	36.480	2,783,132.16	
FIRSTENERGY CORP	45,110	37.410	1,687,565.10	
NEXTERA ENERGY INC	166,491	63.080	10,502,252.28	
NISOURCE INC	34,855	27.070	943,524.85	
NRG ENERGY INC	20,349	73.930	1,504,401.57	
P G & E CORP	159,724	16.600	2,651,418.40	
PPL CORP	55,523	26.630	1,478,577.49	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	39,818	65.870	2,622,811.66	
SEMPRA	48,838	68.690	3,354,682.22	

	SOUTHERN CO/THE	89,277	68.730	6,136,008.21	
	VISTRA CORP	25,777	69.740	1,797,687.98	
	WEC ENERGY GROUP INC	25,816	78.970	2,038,689.52	
	XCEL ENERGY INC	45,776	53.170	2,433,909.92	
	ALPHABET INC-CL A	473,896	157.730	74,747,616.08	
	ALPHABET INC-CL C	412,461	159.190	65,659,666.59	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,601	260.500	1,980,060.50	
	COMCAST CORP-CLASS A	324,219	39.370	12,764,502.03	
	ELECTRONIC ARTS INC	19,428	127.890	2,484,646.92	
	FOX CORP - CLASS A	23,886	30.090	718,729.74	
	FOX CORP - CLASS B	8,773	27.660	242,661.18	
	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	26,027	30.450	792,522.15	
	LIBERTY BROADBAND-C	8,196	48.580	398,161.68	
	LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW	12,383	25.420	314,775.86	
	LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	13,438	67.230	903,436.74	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	13,554	101.040	1,369,496.16	
	MATCH GROUP INC	17,799	32.680	581,671.32	
	META PLATFORMS INC-CLASS A	177,648	511.900	90,938,011.20	
	NETFLIX INC	35,164	622.830	21,901,194.12	
	NEWS CORP - CLASS A	34,405	24.360	838,105.80	
	OMNICOM GROUP	15,106	90.590	1,368,452.54	
	PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	40,964	10.960	448,965.44	
	PINTEREST INC- CLASS A	48,115	33.540	1,613,777.10	
	ROBLOX CORP -CLASS A	37,893	38.370	1,453,954.41	
	ROKU INC	9,945	59.900	595,705.50	
	SEA LTD-ADR	28,343	53.280	1,510,115.04	
	SIRIUS XM HOLDINGS INC	56,550	3.210	181,525.50	
	SNAP INC - A	86,463	10.850	938,123.55	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	12,652	147.270	1,863,260.04	
	TRADE DESK INC/THE -CLASS A	36,722	86.370	3,171,679.14	
	WALT DISNEY CO/THE	145,455	114.010	16,583,324.55	
	WARNER BROS DISCOVERY INC	201,390	8.340	1,679,592.60	
	CBRE GROUP INC - A	23,502	89.390	2,100,843.78	
	COSTAR GROUP INC	30,836	90.340	2,785,724.24	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	79,100	2.990	236,509.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	10,672	44.420	474,050.24	
アメリカ・ドル小計		27,209,222		3,522,767,113.03 (540,603,841,166)	
カナダ・ドル	ARC RESOURCES LTD	44,923	25.550	1,147,782.65	
	CAMECO CORP	33,586	68.300	2,293,923.80	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	87,389	109.040	9,528,896.56	
	CENOVUS ENERGY INC	120,048	28.850	3,463,384.80	
	ENBRIDGE INC	171,808	47.070	8,087,002.56	
	IMPERIAL OIL LTD	16,267	96.350	1,567,325.45	

KEYERA CORP	19,802	34.690	686,931.38	
MEG ENERGY CORP	21,651	31.420	680,274.42	
PARKLAND CORP	7,666	40.940	313,846.04	
PEMBINA PIPELINE CORP	45,973	47.830	2,198,888.59	
SUNCOR ENERGY INC	100,785	51.920	5,232,757.20	
TC ENERGY CORP	81,340	49.730	4,045,038.20	
TOURMALINE OIL CORP	26,107	65.660	1,714,185.62	
AGNICO EAGLE MINES LTD	41,898	84.640	3,546,246.72	
BARRICK GOLD CORP	139,992	24.630	3,448,002.96	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,268	68.610	910,317.48	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	41,452	15.270	632,972.04	
FRANCO-NEVADA CORP	14,724	162.650	2,394,858.60	
IVANHOE MINES LTD-CL A	56,432	18.360	1,036,091.52	
KINROSS GOLD CORP	110,156	8.780	967,169.68	
LUNDIN MINING CORP	46,446	15.620	725,486.52	
NUTRIEN LTD	42,180	72.920	3,075,765.60	
PAN AMERICAN SILVER CORP	25,157	26.410	664,396.37	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	34,947	66.010	2,306,851.47	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,438	109.000	483,742.00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	34,221	71.340	2,441,326.14	
CAE INC	27,474	26.770	735,478.98	
STANTEC INC	9,939	110.550	1,098,756.45	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	6,027	128.930	777,061.11	
WSP GLOBAL INC	9,260	211.000	1,953,860.00	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	32,674	21.540	703,797.96	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	15,630	46.010	719,136.30	
RB GLOBAL INC	15,569	100.650	1,567,019.85	
THOMSON REUTERS CORP	12,639	209.890	2,652,799.71	
AIR CANADA	12,083	18.470	223,173.01	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	42,942	176.950	7,598,586.90	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	75,033	118.550	8,895,162.15	
TFI INTERNATIONAL INC	6,995	214.970	1,503,715.15	
MAGNA INTERNATIONAL INC	22,436	68.680	1,540,904.48	
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,082	96.180	296,426.76	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	11,302	49.040	554,250.08	
RESTAURANT BRANDS INTERN	22,860	98.180	2,244,394.80	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	4,737	127.820	605,483.34	
DOLLARAMA INC	24,084	112.050	2,698,612.20	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	63,190	75.430	4,766,421.70	
EMPIRE CO LTD 'A'	9,148	31.870	291,546.76	
LOBLAW COMPANIES LTD	11,573	146.590	1,696,486.07	
METRO INC/CN	18,929	70.610	1,336,576.69	
WESTON (GEORGE) LTD	4,984	175.840	876,386.56	
SAPUTO INC	18,270	26.030	475,568.10	

	BANK OF MONTREAL	56,754	128.150	7,273,025.10	
	BANK OF NOVA SCOTIA	95,377	66.410	6,333,986.57	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	73,290	66.150	4,848,133.50	
	NATIONAL BANK OF CANADA	25,956	110.960	2,880,077.76	
	ROYAL BANK OF CANADA	111,382	135.660	15,110,082.12	
	TORONTO-DOMINION BANK	143,729	78.290	11,252,543.41	
	BROOKFIELD ASSET MGMT-A	31,451	54.250	1,706,216.75	
	BROOKFIELD CORP	109,779	54.130	5,942,337.27	
	IGM FINANCIAL INC	4,949	33.810	167,325.69	
	ONEX CORPORATION	4,217	96.670	407,657.39	
	TMX GROUP LTD	26,034	36.110	940,087.74	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,745	1,477.060	2,577,469.70	
	GREAT-WEST LIFECO INC	22,964	40.360	926,827.04	
	IA FINANCIAL CORP INC	8,268	81.980	677,810.64	
	INTACT FINANCIAL CORP	14,283	219.250	3,131,547.75	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	144,268	31.950	4,609,362.60	
	POWER CORP OF CANADA	50,268	36.460	1,832,771.28	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	46,259	70.210	3,247,844.39	
	CGI INC	15,720	143.890	2,261,950.80	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,609	3,581.700	5,762,955.30	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,424	122.210	785,077.04	
	OPEN TEXT CORP	21,507	48.920	1,052,122.44	
	SHOPIFY INC - CLASS A	96,532	96.430	9,308,580.76	
	BCE INC	8,653	44.230	382,722.19	
	QUEBECOR INC -CL B	14,578	29.710	433,112.38	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	28,451	52.420	1,491,401.42	
	TELUS CORP	15,222	21.870	332,905.14	
	ALTAGAS LTD	27,309	29.280	799,607.52	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,200	30.800	344,960.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	7,344	30.170	221,568.48	
	EMERA INC	22,591	47.070	1,063,358.37	
	FORTIS INC	41,868	51.840	2,170,437.12	
	HYDRO ONE LTD	24,747	38.080	942,365.76	
	NORTHLAND POWER INC	15,741	22.140	348,505.74	
	FIRSTSERVICE CORP	3,669	212.480	779,589.12	
カナダ・ドル小計		3,197,654		211,751,395.76 (23,599,693,057)	
オーストラリア・ドル	AMPOL LTD	19,016	39.320	747,709.12	
	SANTOS LTD	278,806	7.810	2,177,474.86	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	146,210	30.200	4,415,542.00	
	BHP GROUP LTD	403,597	45.520	18,371,735.44	
	BLUESCOPE STEEL LTD	37,214	23.860	887,926.04	
	FORTESCUE LTD	135,233	25.750	3,482,249.75	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	36,927	57.450	2,121,456.15	

	MINERAL RESOURCES LTD	11,662	72.030	840,013.86	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	92,960	15.300	1,422,288.00	
	ORICA LTD	36,212	17.970	650,729.64	
	PILBARA MINERALS LTD	280,194	4.050	1,134,785.70	
	RIO TINTO LTD	29,368	127.900	3,756,167.20	
	SOUTH32 LTD	336,639	3.290	1,107,542.31	
	REECE LTD	13,059	27.650	361,081.35	
	SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	16,425	40.070	658,149.75	
	BRAMBLES LTD	105,161	15.770	1,658,388.97	
	COMPUTERSHARE LTD	50,853	28.240	1,436,088.72	
	AURIZON HOLDINGS LTD	130,251	3.990	519,701.49	
	QANTAS AIRWAYS LTD	78,226	5.720	447,452.72	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	45,243	41.160	1,862,201.88	
	IDP EDUCATION LTD	23,591	16.220	382,646.02	
	LOTTERY CORP LTD/THE	173,268	5.060	876,736.08	
	WESFARMERS LTD	92,796	66.700	6,189,493.20	
	COLES GROUP LTD	99,972	16.150	1,614,547.80	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	138,738	5.240	726,987.12	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	98,099	32.220	3,160,749.78	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	62,913	12.410	780,750.33	
	COCHLEAR LTD	5,404	320.060	1,729,604.24	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	14,565	52.000	757,380.00	
	SONIC HEALTHCARE LTD	37,362	27.070	1,011,389.34	
	CSL LTD	38,360	281.700	10,806,012.00	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	237,876	28.950	6,886,510.20	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	133,914	116.240	15,566,163.36	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	252,991	34.150	8,639,642.65	
	WESTPAC BANKING CORP	287,982	26.020	7,493,291.64	
	ASX LTD	15,385	63.970	984,178.45	
	MACQUARIE GROUP LTD	28,015	189.770	5,316,406.55	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	22,786	34.600	788,395.60	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	173,755	6.450	1,120,719.75	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	193,702	3.740	724,445.48	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	124,450	17.810	2,216,454.50	
	SUNCORP GROUP LTD	88,234	16.230	1,432,037.82	
	WISETECH GLOBAL LTD	12,907	90.340	1,166,018.38	
	XERO LTD	11,173	121.960	1,362,659.08	
	TELSTRA GROUP LTD	273,343	3.760	1,027,769.68	
	ORIGIN ENERGY LTD	134,865	9.770	1,317,631.05	
	CAR GROUP LTD	33,837	34.060	1,152,488.22	
	REA GROUP LTD	3,813	179.080	682,832.04	
	SEEK LTD	29,833	24.950	744,333.35	
オーストラリア・ドル小計		5,127,185		134,716,958.66 (13,381,435,504)	

香港・ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	196,924	37.250	7,335,419.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	121,500	110.800	13,462,200.00	
	MTR CORP	118,500	25.000	2,962,500.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	160,000	15.620	2,499,200.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	176,000	39.800	7,004,800.00	
	SANDS CHINA LTD	172,800	21.950	3,792,960.00	
	WH GROUP LTD	722,000	5.520	3,985,440.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	247,000	22.750	5,619,250.00	
	HANG SENG BANK LTD	63,400	98.500	6,244,900.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	92,300	228.200	21,062,860.00	
	AIA GROUP LTD	921,000	48.600	44,760,600.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	41,000	44.500	1,824,500.00	
	CLP HOLDINGS LTD	142,100	61.500	8,739,150.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	861,389	5.930	5,108,036.77	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	111,000	44.550	4,945,050.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	160,924	31.850	5,125,429.40	
	ESR GROUP LTD	157,000	8.450	1,326,650.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	190,000	8.100	1,539,000.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	145,384	23.500	3,416,524.00	
	SINO LAND CO	248,200	7.970	1,978,154.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	108,000	73.050	7,889,400.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	27,000	60.500	1,633,500.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	116,800	15.260	1,782,368.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	113,000	25.250	2,853,250.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	125,000	24.000	3,000,000.00	
香港・ドル小計		5,538,221		169,891,141.17 (3,326,468,544)	
シンガポール・ドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	10,800	26.900	290,520.00	
	KEPPEL LTD	115,000	7.160	823,400.00	
	SEATRIUM LTD	3,231,727	0.081	261,769.88	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	108,600	3.990	433,314.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	113,566	6.440	731,365.04	
	GENTING SINGAPORE LTD	452,500	0.910	411,775.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	159,600	3.540	564,984.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	148,700	36.120	5,371,044.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	270,600	13.770	3,726,162.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	102,400	29.570	3,027,968.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	65,200	9.130	595,276.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	645,315	2.370	1,529,396.55	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	89,200	5.410	482,572.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	220,100	2.680	589,868.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	49,000	5.790	283,710.00	
シンガポール・ドル小計		5,782,308		19,123,124.47 (2,156,705,978)	

ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	96,702	8.030	776,517.06	
	EBOS GROUP LTD	12,972	35.110	455,446.92	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	46,548	26.230	1,220,954.04	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	188,606	4.700	886,448.20	
	MERCURY NZ LTD	40,976	6.600	270,441.60	
	MERIDIAN ENERGY LTD	91,327	5.780	527,870.06	
ニュージーランド・ドル小計		477,131		4,137,677.88 (377,025,208)	
イギリス・ポンド	BP PLC	1,345,084	5.391	7,251,347.84	
	SHELL PLC	525,932	29.370	15,446,622.84	
	ANGLO AMERICAN PLC	104,777	22.015	2,306,665.65	
	ANTOFAGASTA PLC	30,983	22.660	702,074.78	
	CRH PLC	57,555	67.020	3,857,336.10	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,296	47.580	489,883.68	
	ENDEAVOUR MINING PLC	17,507	18.430	322,654.01	
	GLENCORE PLC	811,618	4.857	3,942,028.62	
	MONDI PLC	30,822	14.110	434,898.42	
	RIO TINTO PLC	90,715	53.750	4,875,931.25	
	ASHTEAD GROUP PLC	35,259	57.960	2,043,611.64	
	BAE SYSTEMS PLC	251,236	13.185	3,312,546.66	
	BUNZL PLC	26,105	29.740	776,362.70	
	DCC PLC	5,954	55.700	331,637.80	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	119,456	6.438	769,057.72	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	649,146	4.047	2,627,093.86	
	SMITHS GROUP PLC	24,369	16.490	401,844.81	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,904	95.050	561,175.20	
	EXPERIAN PLC	73,697	33.110	2,440,107.67	
	INTERTEK GROUP PLC	11,884	48.040	570,907.36	
	RELX PLC	152,138	33.390	5,079,887.82	
	RENTOKIL INITIAL PLC	190,467	4.530	862,815.51	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,766	4.600	297,923.60	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,637	45.620	302,779.94	
	BURBERRY GROUP PLC	26,233	11.695	306,794.93	
	PERSIMMON PLC	27,665	12.820	354,665.30	
	TAYLOR WIMPEY PLC	353,772	1.346	476,177.11	
	COMPASS GROUP PLC	136,342	21.820	2,974,982.44	
	ENTAIN PLC	42,158	8.208	346,032.86	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	13,924	152.200	2,119,232.80	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	14,491	78.040	1,130,877.64	
	PEARSON PLC	46,942	10.055	472,001.81	
	WHITBREAD PLC	16,522	31.750	524,573.50	
	JD SPORTS FASHION PLC	251,482	1.187	298,509.13	
	KINGFISHER PLC	179,593	2.495	448,084.53	
	NEXT PLC	9,030	90.440	816,673.20	

OCADO GROUP PLC	42,697	3.567	152,300.19	
SAINSBURY (J) PLC	113,480	2.616	296,863.68	
TESCO PLC	551,571	2.829	1,560,394.35	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	30,992	24.060	745,667.52	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	167,558	23.070	3,865,563.06	
COCA-COLA HBC AG-DI	17,866	24.080	430,213.28	
DIAGEO PLC	179,783	27.840	5,005,158.72	
IMPERIAL BRANDS PLC	69,831	17.150	1,197,601.65	
HALEON PLC	547,292	3.229	1,767,205.86	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	56,558	42.000	2,375,436.00	
UNILEVER PLC	197,070	37.950	7,478,806.50	
NMC HEALTH PLC	3,940	0.010	39.40	
SMITH & NEPHEW PLC	57,278	9.612	550,556.13	
ASTRAZENECA PLC	124,946	110.640	13,824,025.44	
GSK PLC	326,183	16.435	5,360,817.60	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	14,590	18.030	263,057.70	
BARCLAYS PLC	1,208,742	1.828	2,209,580.37	
HSBC HOLDINGS PLC	1,552,941	6.534	10,146,916.49	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,165,051	0.509	2,629,010.95	
NATWEST GROUP PLC	407,238	2.745	1,117,868.31	
STANDARD CHARTERED PLC	182,397	6.628	1,208,927.31	
3I GROUP PLC	81,145	28.290	2,295,592.05	
ABRDN PLC	138,015	1.394	192,392.91	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	31,008	7.334	227,412.67	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	32,399	93.140	3,017,642.86	
M&G PLC	217,201	2.004	435,270.80	
SCHRODERS PLC	61,711	3.750	231,416.25	
ST JAMES'S PLACE PLC	33,823	4.158	140,636.03	
WISE PLC - A	43,661	9.460	413,033.06	
ADMIRAL GROUP PLC	19,808	26.710	529,071.68	
AVIVA PLC	217,835	4.602	1,002,476.67	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	457,083	2.476	1,131,737.50	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	59,286	5.035	298,505.01	
PRUDENTIAL PLC	211,966	7.064	1,497,327.82	
SAGE GROUP PLC/THE	75,045	11.805	885,906.22	
HALMA PLC	32,277	22.270	718,808.79	
BT GROUP PLC	540,623	1.071	579,007.23	
VODAFONE GROUP PLC	1,981,261	0.672	1,331,407.39	
CENTRICA PLC	403,810	1.333	538,278.73	
NATIONAL GRID PLC	301,486	10.375	3,127,917.25	
SEVERN TRENT PLC	20,117	23.960	482,003.32	
SSE PLC	87,793	16.670	1,463,509.31	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	51,208	10.145	519,505.16	
AUTO TRADER GROUP PLC	77,901	6.874	535,491.47	

	INFORMA PLC	102,755	8.070	829,232.85	
	WPP PLC	78,503	7.656	601,018.96	
イギリス・ポンド小計		22,136,185		155,486,413.23 (29,721,227,889)	
イスラエル・シュケル	ICL GROUP LTD	67,143	17.940	1,204,545.42	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,213	766.200	1,695,600.60	
	BANK HAPOALIM BM	98,327	33.200	3,264,456.40	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	115,937	29.200	3,385,360.40	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	118,638	18.700	2,218,530.60	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	11,916	132.700	1,581,253.20	
	NICE LTD	4,458	882.500	3,934,185.00	
	AZRIELI GROUP LTD	3,527	250.900	884,924.30	
イスラエル・シュケル小計		422,159		18,168,855.92 (742,646,535)	
スイス・フラン	CLARIANT AG-REG	10,101	13.100	132,323.10	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	538	702.500	377,945.00	
	GIVAUDAN-REG	771	3,916.000	3,019,236.00	
	HOLCIM LTD	42,879	78.980	3,386,583.42	
	SIG GROUP AG	22,269	19.290	429,569.01	
	SIKA AG-REG	12,022	263.400	3,166,594.80	
	ABB LTD-REG	130,006	41.870	5,443,351.22	
	GEBERIT AG-REG	2,873	502.800	1,444,544.40	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,766	215.000	379,690.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,030	221.400	670,842.00	
	VAT GROUP AG	2,164	482.800	1,044,779.20	
	ADECCO GROUP AG-REG	14,810	34.500	510,945.00	
	SGS SA-REG	11,450	81.660	935,007.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	4,194	253.700	1,064,017.80	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	42,892	128.050	5,492,320.60	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	2,619	200.000	523,800.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	5,225	39.150	204,558.75	
	AVOLTA AG	8,656	35.620	308,326.72	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	216	1,302.000	281,232.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	72	10,360.000	745,920.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	103,200.000	825,600.00	
	NESTLE SA-REG	214,178	93.040	19,927,121.12	
	ALCON INC	41,643	74.180	3,089,077.74	
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,173	256.400	1,069,957.20	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,823	138.550	1,222,426.65	
	BACHEM HOLDING AG	1,756	80.650	141,621.40	
	LONZA GROUP AG-REG	5,801	535.000	3,103,535.00	
	NOVARTIS AG-REG	165,157	86.100	14,220,017.70	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,584	241.800	624,811.20	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	55,907	225.000	12,579,075.00	

	SANDOZ GROUP AG	30,936	26.910	832,487.76	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	3,006	101.300	304,507.80	
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,168	51.360	779,028.48	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,773	1,271.000	2,253,483.00	
	UBS GROUP AG-REG	264,202	26.350	6,961,722.70	
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,909	139.500	545,305.50	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,221	122.500	272,072.50	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,272	621.200	1,411,366.40	
	SWISS RE AG	24,764	106.000	2,624,984.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,811	451.500	5,332,666.50	
	TEMENOS AG - REG	3,743	61.400	229,820.20	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	13,555	79.720	1,080,604.60	
	SWISSCOM AG-REG	1,994	518.000	1,032,892.00	
	BKW AG	1,385	140.800	195,008.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,572	85.100	474,177.20	
スイス・フラン小計		1,204,894		110,694,955.67 (18,585,683,057)	
デンマーク・クローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	30,327	384.000	11,645,568.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	407	2,202.000	896,214.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	78,424	179.600	14,084,950.40	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	206	9,465.000	1,949,790.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	412	9,646.000	3,974,152.00	
	DSV A/S	13,716	1,122.500	15,396,210.00	
	PANDORA A/S	6,892	1,063.500	7,329,642.00	
	CARLSBERG AS-B	8,080	911.400	7,364,112.00	
	COLOPLAST-B	10,365	907.600	9,407,274.00	
	DEMANT A/S	8,178	319.000	2,608,782.00	
	GENMAB A/S	5,493	2,067.000	11,354,031.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	259,962	880.000	228,766,560.00	
	DANSKE BANK A/S	59,312	203.300	12,058,129.60	
	TRYG A/S	24,975	137.700	3,439,057.50	
	ORSTED A/S	14,988	405.000	6,070,140.00	
デンマーク・クローネ小計		521,737		336,344,612.50 (7,365,947,014)	
ノルウェー・クローネ	AKER BP ASA	21,204	302.700	6,418,450.80	
	EQUINOR ASA	72,237	313.900	22,675,194.30	
	NORSK HYDRO ASA	108,109	71.600	7,740,604.40	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,718	337.500	4,292,325.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	6,526	769.000	5,018,494.00	
	MOWI ASA	36,354	191.050	6,945,431.70	
	ORKLA ASA	63,195	77.600	4,903,932.00	
	SALMAR ASA	6,204	680.500	4,221,822.00	
	DNB BANK ASA	78,029	216.000	16,854,264.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,691	162.100	3,029,811.10	

	TELENOR ASA	48,435	122.700	5,942,974.50	
	ADEVINTA ASA	21,858	114.100	2,493,997.80	
ノルウェー・クローネ小計		493,560		90,537,301.60 (1,277,481,326)	
スウェーデン・クローナ	BOLIDEN AB	20,658	351.800	7,267,484.40	
	HOLMEN AB-B SHARES	7,024	431.400	3,030,153.60	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	45,662	155.300	7,091,308.60	
	ALFA LAVAL AB	23,093	418.900	9,673,657.70	
	ASSA ABLOY AB-B	80,816	305.800	24,713,532.80	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	217,094	182.800	39,684,783.20	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	125,066	159.500	19,948,027.00	
	BEIJER REF AB	23,918	151.600	3,625,968.80	
	EPIROC AB-A	56,566	213.700	12,088,154.20	
	EPIROC AB-B	33,182	190.500	6,321,171.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	34,897	83.200	2,903,430.40	
	INDUTRADE AB	17,913	280.600	5,026,387.80	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,223	278.500	2,290,105.50	
	LIFCO AB-B SHS	15,149	275.000	4,165,975.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	109,274	50.660	5,535,820.84	
	SAAB AB-B	6,953	919.400	6,392,588.20	
	SANDVIK AB	87,237	239.000	20,849,643.00	
	SKANSKA AB-B SHS	26,915	192.400	5,178,446.00	
	SKF AB-B SHARES	31,715	218.700	6,936,070.50	
	VOLVO AB-A SHS	13,283	292.400	3,883,949.20	
	VOLVO AB-B SHS	124,286	284.400	35,346,938.40	
	SECURITAS AB-B SHS	41,010	109.300	4,482,393.00	
	VOLVO CAR AB -RED SHS	100,230	3.654	366,240.42	
	VOLVO CAR AB-B	100,230	40.845	4,093,894.35	
	EVOLUTION AB	14,444	1,297.500	18,741,090.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	52,210	164.350	8,580,713.50	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	45,427	252.600	11,474,860.20	
	GETINGE AB-B SHS	21,124	209.700	4,429,702.80	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	13,513	252.800	3,416,086.40	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	129,315	146.500	18,944,647.50	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	113,533	109.500	12,431,863.50	
	SWEDBANK AB - A SHARES	63,538	215.500	13,692,439.00	
	EQT AB	29,893	322.900	9,652,449.70	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	10,598	356.600	3,779,246.80	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,642	355.800	3,786,423.60	
	INVESTOR AB-B SHS	141,543	260.800	36,914,414.40	
	LUNDBERGS AB-B SHS	6,081	545.500	3,317,185.50	
	ERICSSON LM-B SHS	221,040	54.020	11,940,580.80	
	HEXAGON AB-B SHS	175,674	124.300	21,836,278.20	
	TELE2 AB-B SHS	38,424	93.420	3,589,570.08	

	TELIA CO AB	187,675	26.040	4,887,057.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	60,454	67.620	4,087,899.48	
	SAGAX AB-B	14,721	259.800	3,824,515.80	
スウェーデン・クローナ小計		2,700,243		440,223,148.17 (6,220,353,084)	
ユーロ	ENI SPA	179,276	15.730	2,820,011.48	
	GALP ENERGIA SGPS SA	31,541	16.425	518,060.92	
	NESTE OYJ	31,509	27.320	860,825.88	
	OMV AG	10,043	45.000	451,935.00	
	REPSOL SA	96,457	15.875	1,531,254.87	
	TENARIS SA	41,201	18.425	759,128.42	
	TOTALENERGIES SE	175,277	69.090	12,109,887.93	
	AIR LIQUIDE SA	41,216	187.380	7,723,054.08	
	AKZO NOBEL N.V.	12,475	65.560	817,861.00	
	ARCELORMITTAL	44,177	25.720	1,136,232.44	
	ARKEMA	5,145	97.450	501,380.25	
	BASF SE	70,317	51.650	3,631,873.05	
	COVESTRO AG	16,049	49.810	799,400.69	
	DSM-FIRMENICH AG	13,915	101.350	1,410,285.25	
	EVONIK INDUSTRIES AG	17,669	18.880	333,590.72	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	11,273	96.880	1,092,128.24	
	OCI NV	11,025	24.730	272,648.25	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	20,828	41.390	862,070.92	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	47,758	12.670	605,093.86	
	SYENSQO SA	4,802	89.030	427,522.06	
	SYMRISE AG	9,721	104.650	1,017,302.65	
	UMICORE	16,912	21.460	362,931.52	
	UPM-KYMMENE OYJ	42,123	31.280	1,317,607.44	
	VOESTALPINE AG	9,720	26.980	262,245.60	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	19,741	37.920	748,578.72	
	AIRBUS SE	47,599	162.900	7,753,877.10	
	ALSTOM	25,574	14.370	367,498.38	
	BOUYGUES SA	17,123	35.810	613,174.63	
	BRENNTAG SE	12,153	76.420	928,732.26	
	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	34,454	71.900	2,477,242.60	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	44,374	45.090	2,000,823.66	
	DASSAULT AVIATION SA	1,720	204.800	352,256.00	
	EIFFAGE	6,641	98.500	654,138.50	
	FERROVIAL SE	42,157	34.360	1,448,514.52	
	GEA GROUP AG	10,467	37.740	395,024.58	
	IMCD NV	4,340	155.650	675,521.00	
	KINGSPAN GROUP PLC	13,174	82.900	1,092,124.60	
	KNORR-BREMSE AG	7,217	69.050	498,333.85	
	KONE OYJ-B	27,371	44.090	1,206,787.39	
	LEGRAND SA	19,539	94.860	1,853,469.54	

LEONARDO SPA	35,486	22.120	784,950.32	
METSO CORP	50,483	11.475	579,292.42	
MTU AERO ENGINES AG	3,854	217.200	837,088.80	
PRYSMIAN SPA	19,681	48.520	954,922.12	
RATIONAL AG	350	789.500	276,325.00	
REXEL SA	23,491	23.970	563,079.27	
RHEINMETALL AG	3,447	543.200	1,872,410.40	
SAFRAN SA	27,555	205.800	5,670,819.00	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	43,527	209.400	9,114,553.80	
SIEMENS AG-REG	60,728	172.660	10,485,296.48	
SIEMENS ENERGY AG	40,928	17.625	721,356.00	
THALES SA	8,928	158.800	1,417,766.40	
VINCI SA	38,750	113.050	4,380,687.50	
WARTSILA OYJ ABP	38,260	15.350	587,291.00	
BUREAU VERITAS SA	17,817	26.920	479,633.64	
RANDSTAD NV	8,946	48.390	432,896.94	
TELEPERFORMANCE	4,299	89.500	384,760.50	
WOLTERS KLUWER	18,802	141.050	2,652,022.10	
ADP	3,679	119.400	439,272.60	
AENA SME SA	5,640	173.200	976,848.00	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	50,885	6.878	349,987.03	
DHL GROUP	78,125	38.790	3,030,468.75	
GETLINK SE	30,428	15.390	468,286.92	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,500	109.500	2,682,750.00	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	3,679	101.000	371,579.00	
CONTINENTAL AG	8,078	66.060	533,632.68	
DR ING HC F PORSCHE AG	8,498	92.840	788,954.32	
FERRARI NV	10,029	387.600	3,887,240.40	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	65,924	75.370	4,968,691.88	
MICHELIN (CGDE)	51,844	34.860	1,807,281.84	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	14,142	50.620	715,868.04	
RENAULT SA	14,764	50.180	740,857.52	
STELLANTIS NV	177,200	24.385	4,321,022.00	
VOLKSWAGEN AG	1,960	146.100	286,356.00	
VOLKSWAGEN AG-PREF	16,257	123.700	2,010,990.90	
ADIDAS AG	13,498	196.400	2,651,007.20	
HERMES INTERNATIONAL	2,555	2,270.000	5,799,850.00	
KERING	5,801	350.500	2,033,250.50	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	22,217	781.200	17,355,920.40	
MONCLER SPA	15,710	64.160	1,007,953.60	
PUMA SE	9,601	40.390	387,784.39	
SEB SA	1,127	113.600	128,027.20	
ACCOR SA	16,469	40.120	660,736.28	
AMADEUS IT GROUP SA	34,652	57.100	1,978,629.20	

DELIVERY HERO SE	13,293	31.470	418,330.71	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,785	37.040	214,276.40	
SODEXO SA	6,960	76.600	533,136.00	
D'IETEREN GROUP	1,885	205.200	386,802.00	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	89,198	43.660	3,894,384.68	
PROSUS NV	114,557	29.430	3,371,412.51	
ZALANDO SE	17,418	26.550	462,447.90	
CARREFOUR SA	49,914	15.855	791,386.47	
JERONIMO MARTINS	22,106	18.250	403,434.50	
KESKO OYJ-B SHS	20,250	16.915	342,528.75	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	71,069	26.630	1,892,567.47	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	71,161	55.460	3,946,589.06	
DANONE	50,315	57.780	2,907,200.70	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	48,521	8.898	431,739.85	
HEINEKEN HOLDING NV	7,962	73.000	581,226.00	
HEINEKEN NV	22,805	88.000	2,006,840.00	
JDE PEET'S NV	13,317	19.250	256,352.25	
KERRY GROUP PLC-A	12,402	80.500	998,361.00	
LOTUS BAKERIES	31	8,830.000	273,730.00	
PERNOD RICARD SA	16,118	141.250	2,276,667.50	
REMY COINTREAU	2,008	90.050	180,820.40	
BEIERSDORF AG	7,876	131.150	1,032,937.40	
HENKEL AG & CO KGAA	8,714	65.400	569,895.60	
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	15,381	71.860	1,105,278.66	
L'OREAL	19,010	414.500	7,879,645.00	
AMPLIFON SPA	10,123	31.410	317,963.43	
BIOMERIEUX	2,791	104.600	291,938.60	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,583	102.300	366,540.90	
DIASORIN SPA	1,313	86.700	113,837.10	
ESSILORLUXOTTICA	23,299	202.800	4,725,037.20	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	17,125	35.440	606,910.00	
FRESENIUS SE & CO KGAA	31,227	25.420	793,790.34	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	60,155	19.115	1,149,862.82	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	23,498	53.400	1,254,793.20	
ARGENX SE	4,867	352.500	1,715,617.50	
BAYER AG-REG	75,808	26.965	2,044,162.72	
EUROFINS SCIENTIFIC	9,270	59.800	554,346.00	
GRIFOLS SA	15,169	8.574	130,059.00	
IPSEN	3,380	109.400	369,772.00	
MERCK KGAA	9,982	153.600	1,533,235.20	
ORION OYJ-CLASS B	10,542	33.000	347,886.00	
QIAGEN N.V.	20,951	38.115	798,547.36	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	8,068	49.420	398,720.56	
SANOFI	92,427	86.470	7,992,162.69	

SARTORIUS AG-VORZUG	2,164	334.900	724,723.60	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,207	250.600	553,074.20	
UCB SA	10,230	120.650	1,234,249.50	
ABN AMRO BANK NV-CVA	28,787	15.840	455,986.08	
AIB GROUP PLC	108,430	4.796	520,030.28	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	484,418	10.050	4,868,400.90	
BANCO BPM SPA	91,957	6.084	559,466.38	
BANCO SANTANDER SA	1,274,611	4.448	5,669,469.72	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	87,661	9.770	856,447.97	
BNP PARIBAS	80,474	65.360	5,259,780.64	
CAIXABANK SA	308,048	4.668	1,437,968.06	
COMMERZBANK AG	82,105	12.950	1,063,259.75	
CREDIT AGRICOLE SA	90,899	13.760	1,250,770.24	
ERSTE GROUP BANK AG	29,155	42.210	1,230,632.55	
FINECOBANK SPA	43,093	13.995	603,086.53	
ING GROEP NV	270,895	14.946	4,048,796.67	
INTESA SANPAOLO	1,152,986	3.290	3,793,323.94	
KBC GROUP NV	20,304	68.680	1,394,478.72	
MEDIOBANCA SPA	47,708	13.575	647,636.10	
NORDEA BANK ABP	243,753	10.780	2,627,657.34	
SOCIETE GENERALE SA	55,196	25.760	1,421,848.96	
UNICREDIT SPA	121,851	34.045	4,148,417.29	
ADYEN NV	1,711	1,421.600	2,432,357.60	
AMUNDI SA	3,955	63.700	251,933.50	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	146,020	14.788	2,159,343.76	
DEUTSCHE BOERSE AG	14,432	189.700	2,737,750.40	
EDENRED	20,297	44.680	906,869.96	
EURAZEO SE	3,897	82.000	319,554.00	
EURONEXT NV	7,818	87.300	682,511.40	
EXOR NV	8,669	100.500	871,234.50	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	7,933	69.650	552,533.45	
NEXI SPA	57,060	5.486	313,031.16	
SOFINA	804	216.000	173,664.00	
WORLDLINE SA	16,677	10.805	180,194.98	
AEGON LTD	127,748	5.570	711,556.36	
AGEAS	11,247	42.480	477,772.56	
ALLIANZ SE-REG	31,873	262.000	8,350,726.00	
ASR NEDERLAND NV	14,593	45.120	658,436.16	
ASSICURAZIONI GENERALI	82,510	22.760	1,877,927.60	
AXA SA	148,668	33.660	5,004,164.88	
HANNOVER RUECK SE	5,315	230.600	1,225,639.00	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	10,609	415.600	4,409,100.40	
NN GROUP NV	20,802	43.170	898,022.34	
POSTE ITALIANE SPA	34,720	11.575	401,884.00	

SAMPO OYJ-A SHS	36,423	39.410	1,435,430.43	
TALANX AG	5,345	69.400	370,943.00	
BECHTLE AG	8,953	48.140	430,997.42	
CAPGEMINI SE	12,750	207.500	2,645,625.00	
DASSAULT SYSTEMES SE	50,781	39.250	1,993,154.25	
NEMETSCHEK SE	5,941	85.250	506,470.25	
SAP SE	83,000	171.060	14,197,980.00	
NOKIA OYJ	404,925	3.172	1,284,422.10	
ASM INTERNATIONAL NV	3,686	584.600	2,154,835.60	
ASML HOLDING NV	32,361	907.500	29,367,607.50	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	6,286	143.900	904,555.40	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	102,926	32.060	3,299,807.56	
STMICROELECTRONICS NV	54,733	39.020	2,135,681.66	
CELLNEX TELECOM SA	32,894	31.010	1,020,042.94	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	258,987	21.180	5,485,344.66	
ELISA OYJ	14,245	42.160	600,569.20	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	28,190	9.935	280,067.65	
KONINKLIJKE KPN NV	300,581	3.402	1,022,576.56	
ORANGE	132,722	10.435	1,384,954.07	
TELECOM ITALIA SPA	696,355	0.228	158,768.94	
TELEFONICA SA	412,202	3.959	1,631,907.71	
ACCIONA SA	1,810	110.100	199,281.00	
E.ON SE	178,555	12.455	2,223,902.52	
EDP RENOVAVEIS SA	27,294	13.110	357,824.34	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	265,763	3.615	960,733.24	
ELIA GROUP SA/NV	2,111	94.750	200,017.25	
ENAGAS SA	14,471	13.750	198,976.25	
ENDESA SA	25,535	17.300	441,755.50	
ENEL SPA	662,902	5.873	3,893,223.44	
ENGIE	142,233	15.880	2,258,660.04	
FORTUM OYJ	42,339	12.295	520,558.00	
IBERDROLA SA	490,939	11.250	5,523,063.75	
REDEIA CORP SA	34,539	15.770	544,680.03	
RWE AG	48,289	32.490	1,568,909.61	
SNAM SPA	168,809	4.288	723,852.99	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA	101,686	7.480	760,611.28	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	57,958	28.450	1,648,905.10	
VERBUND AG	5,338	70.900	378,464.20	
BOLLORE SE	69,288	6.215	430,624.92	
PUBLICIS GROUPE	18,281	103.500	1,892,083.50	
SCOUT24 SE	6,149	68.100	418,746.90	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	66,170	27.040	1,789,236.80	
VIVENDI SE	57,161	9.928	567,494.40	
LEG IMMOBILIEN SE	6,505	75.560	491,517.80	

	VONOVIA SE	55,940	25.240	1,411,925.60	
ユーロ小計		14,206,942		411,614,505.41 (67,257,810,184)	
合　計		89,017,441		714,616,318,545 (714,616,318,545)	

（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	591銘柄	71.9%	75.6%
カナダ・ドル	株式	85銘柄	3.1%	3.3%
オーストラリア・ドル	株式	49銘柄	1.8%	1.9%
香港・ドル	株式	25銘柄	0.4%	0.5%
シンガポール・ドル	株式	15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	82銘柄	4.0%	4.2%
イスラエル・シュケル	株式	8銘柄	0.1%	0.1%
スイス・フラン	株式	45銘柄	2.5%	2.6%
デンマーク・クローネ	株式	15銘柄	1.0%	1.0%
ノルウェー・クローネ	株式	12銘柄	0.2%	0.2%
スウェーデン・クローナ	株式	43銘柄	0.8%	0.9%
ユーロ	株式	217銘柄	8.9%	9.4%

(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	1,625,711.12	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	26,290.00	934,872.40	
		AMERICAN TOWER CORP	36,440.00	6,530,048.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	35,166.00	648,461.04	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,975.00	2,200,765.50	
		BOSTON PROPERTIES INC	13,802.00	836,539.22	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,861.00	769,906.34	
		CROWN CASTLE INC	33,131.00	3,204,099.01	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	24,875.00	3,544,438.75	
		EQUINIX INC	7,520.00	5,745,656.00	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,256.00	870,043.68	
		EQUITY RESIDENTIAL	26,128.00	1,611,836.32	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,455.00	1,305,326.95	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	17,630.00	2,480,364.70	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	22,625.00	972,422.50	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	65,292.00	1,209,207.84	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	59,277.00	1,185,540.00	
		INVITATION HOMES INC	44,730.00	1,517,241.60	
		IRON MOUNTAIN INC	23,774.00	1,807,299.48	
		KIMCO REALTY CORP	57,934.00	1,048,605.40	

	MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,567.00	1,225,819.71	
	PROLOGIS INC	74,899.00	8,912,981.00	
	PUBLIC STORAGE	12,964.00	3,528,022.96	
	REALTY INCOME CORP	63,896.00	3,323,869.92	
	REGENCY CENTERS CORP	13,101.00	766,277.49	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,176.00	1,650,243.84	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	25,788.00	3,734,360.28	
	SUN COMMUNITIES INC	10,118.00	1,221,040.24	
	UDR INC	27,406.00	1,004,155.84	
	VENTAS INC	34,880.00	1,493,910.40	
	VICI PROPERTIES INC	76,652.00	2,141,656.88	
	WELLTOWER INC	45,762.00	4,108,969.98	
	WEYERHAEUSER CO	54,126.00	1,799,148.24	
	WP CAREY INC	16,778.00	922,286.66	
	アメリカ・ドル小計	1,021,617.00	75,881,129.29 (11,644,718,101)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,170.00	358,336.20	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,441.00	132,896.26	
	カナダ・ドル小計	15,611.00	491,232.46 (54,747,859)	
オーストラリア・ドル	APA GROUP	108,912.00	913,771.68	
	DEXUS/AU	79,604.00	593,049.80	
	GOODMAN GROUP	133,948.00	4,291,693.92	
	GPT GROUP	159,776.00	677,450.24	
	MIRVAC GROUP	326,863.00	722,367.23	
	SCENTRE GROUP	452,086.00	1,446,675.20	
	STOCKLAND	193,824.00	885,775.68	
	TRANSURBAN GROUP	235,928.00	3,135,483.12	
	VICINITY CENTRES	372,431.00	724,378.29	
	オーストラリア・ドル小計	2,063,372.00	13,390,645.16 (1,330,092,784)	
香港・ドル	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	276,000.00	2,484,000.00	
	LINK REIT	189,400.00	6,098,680.00	
	香港・ドル小計	465,400.00	8,582,680.00 (168,048,874)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	322,200.00	869,940.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	408,716.00	784,734.72	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	208,100.00	301,745.00	
	MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	112,400.00	148,368.00	
	シンガポール・ドル小計	1,051,416.00	2,104,787.72 (237,377,959)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	59,857.00	379,194.09	
	SEGRO PLC	89,254.00	765,620.81	
	イギリス・ポンド小計	149,111.00	1,144,814.90 (218,831,368)	

	ユーロ	COVIVIO	7,110.00	335,165.40	
		GECINA SA	3,082.00	284,776.80	
		KLEPIERRE	18,172.00	432,857.04	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE	8,942.00	658,310.04	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	14,027.00	355,163.64	
	ユーロ小計		51,333.00	2,066,272.92 (337,628,995)	
投資証券合計				13,991,445,940 (13,991,445,940)	
合　計				13,991,445,940 (13,991,445,940)	

（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	34銘柄	1.5%	83.2%
カナダ・ドル	投資証券	2銘柄	0.0%	0.4%
オーストラリア・ドル	投資証券	9銘柄	0.2%	9.5%
香港・ドル	投資証券	2銘柄	0.0%	1.2%
シンガポール・ドル	投資証券	4銘柄	0.0%	1.7%
イギリス・ポンド	投資証券	2銘柄	0.0%	1.6%
ユーロ	投資証券	5銘柄	0.0%	2.4%

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

外国債券パッシブ・マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

	（2024年4月15日現在）
資産の部	
流動資産	
預金	145,076,596
金銭信託	20,741,125
コール・ローン	979,901,726
国債証券	181,181,944,320
未収利息	1,560,152,285
前払費用	131,900,560
流動資産合計	184,019,716,612
資産合計	184,019,716,612
負債の部	
流動負債	
未払解約金	208,400,281
流動負債合計	208,400,281
負債合計	208,400,281
純資産の部	
元本等	

元本	81,315,169,414
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	102,496,146,917
元本等合計	183,811,316,331
純資産合計	183,811,316,331
負債純資産合計	184,019,716,612

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2023年4月14日 至 2024年4月15日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	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。 (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。 (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。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
２．　デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

（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	（2024年4月15日現在）
１．　当計算期間の末日における受益権の総数	81,315,169,414口
２．　１単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　2.2605円 （１万口当たりの純資産額22,605円）

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	自 2023年4月14日 至 2024年4月15日

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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	（2024年4月15日現在）

１．　貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自　2023年4月14日 至　2024年4月15日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

（2024年4月15日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	77,797,645,540円
同期中における追加設定元本額	14,059,027,731円
同期中における一部解約元本額	10,541,503,857円
2024年4月15日現在の元本の内訳	
三井住友・ＤＣ外国債券インデックスファンドＳ	27,469,231,073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）	1,501,495,418円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	123,942,674円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）	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）	23,975,527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）	295,062,458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）	19,433,369円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	55,911,331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）	63,645,439円

三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	43,497,718円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	363,902,541円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	255,998,229円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	721,985,167円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	234,035,737円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	122,394,943円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	244,673,305円
三井住友ＤＳ・外国債券インデックス年金ファンド	1,123,224,982円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	42,752,565円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	145,382,038円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	114,921,824円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６０	4,355,536円
日興ＦＷＳ・先進国債インデックス（為替ヘッジなし）	3,711,134,389円
三井住友ＤＳ・先進国債インデックス・ファンド	306,782,156円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０３５	4,967,639円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０	3,014,410円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４５	4,417,704円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５５	1,545,228円
三井住友ＤＳ・ＤＣターゲットイヤーファンド２０６５	889,508円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル１（保守型）	617,244円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル２（安定型）	2,086,782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）	10,582,641円
三井住友ＤＳ・ＦＷ専用ポートフォリオ・レベル４（成長型）	7,133,597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）	2,808,455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＞	5,042,144,293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＞	19,033,481円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	3,925,586,429円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	3,590,701,718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＞	28,076,274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＞	647,958,426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＞	835,737,668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＞	3,537,553,856円
ＳＭＡＭ・外国債券パッシブファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	6,127,319,240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）	279,865,791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＞	63,095,153円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	323,945,632円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	67,989,552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＞	760,148,963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＞	473,031,324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＞	239,980,439円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	196,671,104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＞	155,104,729円
ＳＭＡＭ・マルチアセットストラテジーファンド２０１６－０４＜適格機関投資家限定＞	79,237,377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＞	126,857,094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Ⅱ＜適格機関投資家限定＞	1,233,154,777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＞	328,242,532円
合　計	81,315,169,414円

（３）附属明細表

①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	4,167,944.00	
		T 0.25 06/30/25	2,900,000.00	2,736,904.00	
		T 0.25 07/31/25	300,000.00	282,045.00	
		T 0.25 09/30/25	2,000,000.00	1,866,360.00	
		T 0.25 10/31/25	1,000,000.00	929,880.00	
		T 0.375 01/31/26	2,500,000.00	2,305,450.00	
		T 0.375 04/30/25	3,000,000.00	2,857,170.00	
		T 0.375 07/31/27	2,500,000.00	2,173,725.00	
		T 0.375 09/30/27	4,800,000.00	4,146,720.00	
		T 0.375 11/30/25	2,000,000.00	1,857,060.00	
		T 0.375 12/31/25	3,000,000.00	2,776,110.00	
		T 0.5 03/31/25	1,600,000.00	1,531,216.00	
		T 0.5 04/30/27	1,200,000.00	1,057,824.00	
		T 0.5 05/31/27	2,500,000.00	2,196,575.00	
		T 0.5 06/30/27	4,000,000.00	3,504,520.00	
		T 0.5 10/31/27	1,000,000.00	864,960.00	
		T 0.625 03/31/27	2,400,000.00	2,131,200.00	
		T 0.625 05/15/30	5,000,000.00	3,967,750.00	
		T 0.625 07/31/26	800,000.00	727,656.00	
		T 0.625 08/15/30	4,800,000.00	3,774,144.00	
		T 0.625 11/30/27	3,400,000.00	2,946,100.00	
		T 0.625 12/31/27	7,200,000.00	6,220,080.00	
		T 0.75 01/31/28	5,900,000.00	5,106,214.00	
		T 0.75 04/30/26	1,500,000.00	1,380,690.00	

T 0.75 05/31/26	2,000,000.00	1,835,220.00	
T 0.75 08/31/26	1,500,000.00	1,364,325.00	
T 0.875 06/30/26	2,000,000.00	1,835,840.00	
T 0.875 09/30/26	2,500,000.00	2,275,375.00	
T 0.875 11/15/30	4,900,000.00	3,893,001.00	
T 1 07/31/28	2,900,000.00	2,496,030.00	
T 1.125 02/15/31	5,700,000.00	4,583,997.00	
T 1.125 02/28/27	2,000,000.00	1,808,200.00	
T 1.125 05/15/40	3,800,000.00	2,277,682.00	
T 1.125 08/15/40	3,100,000.00	1,839,323.00	
T 1.125 08/31/28	3,500,000.00	3,021,620.00	
T 1.125 10/31/26	3,700,000.00	3,378,322.00	
T 1.25 05/15/50	5,100,000.00	2,477,682.00	
T 1.25 05/31/28	3,000,000.00	2,623,110.00	
T 1.25 06/30/28	3,000,000.00	2,617,260.00	
T 1.25 08/15/31	5,200,000.00	4,147,364.00	
T 1.25 09/30/28	3,000,000.00	2,598,270.00	
T 1.25 11/30/26	4,200,000.00	3,837,750.00	
T 1.25 12/31/26	2,600,000.00	2,371,070.00	
T 1.375 08/15/50	4,500,000.00	2,257,695.00	
T 1.375 08/31/26	600,000.00	554,010.00	
T 1.375 10/31/28	3,000,000.00	2,607,870.00	
T 1.375 11/15/31	4,900,000.00	3,917,305.00	
T 1.375 11/15/40	3,500,000.00	2,160,060.00	
T 1.375 12/31/28	1,000,000.00	865,440.00	
T 1.5 01/31/27	3,400,000.00	3,113,244.00	
T 1.5 02/15/30	2,100,000.00	1,775,235.00	
T 1.5 11/30/28	4,500,000.00	3,926,925.00	
T 1.625 02/15/26	2,900,000.00	2,732,902.00	
T 1.625 05/15/26	11,450,000.00	10,720,406.00	
T 1.625 05/15/31	5,500,000.00	4,542,835.00	
T 1.625 08/15/29	3,750,000.00	3,240,712.50	
T 1.625 09/30/26	900,000.00	834,570.00	
T 1.625 11/15/50	3,200,000.00	1,718,496.00	
T 1.625 11/30/26	200,000.00	184,596.00	
T 1.75 01/31/29	3,300,000.00	2,901,096.00	
T 1.75 08/15/41	4,400,000.00	2,847,768.00	
T 1.75 11/15/29	1,300,000.00	1,126,021.00	
T 1.75 12/31/26	2,500,000.00	2,311,125.00	
T 1.875 02/15/32	5,300,000.00	4,379,284.00	
T 1.875 02/15/41	3,300,000.00	2,209,812.00	
T 1.875 02/15/51	5,800,000.00	3,326,126.00	
T 1.875 02/28/27	3,400,000.00	3,140,206.00	
T 1.875 02/28/29	2,800,000.00	2,473,184.00	

T 1.875 07/31/26	2,500,000.00	2,341,200.00	
T 1.875 11/15/51	3,300,000.00	1,881,099.00	
T 2 02/15/50	2,800,000.00	1,672,328.00	
T 2 08/15/25	3,300,000.00	3,170,706.00	
T 2 08/15/51	2,900,000.00	1,709,956.00	
T 2 11/15/26	1,000,000.00	932,730.00	
T 2 11/15/41	3,800,000.00	2,557,476.00	
T 2.125 05/15/25	600,000.00	581,250.00	
T 2.25 02/15/27	4,400,000.00	4,111,580.00	
T 2.25 02/15/52	1,700,000.00	1,064,676.00	
T 2.25 03/31/26	8,200,000.00	7,798,610.00	
T 2.25 05/15/41	5,000,000.00	3,548,800.00	
T 2.25 08/15/27	4,200,000.00	3,885,798.00	
T 2.25 08/15/46	1,950,000.00	1,279,102.50	
T 2.25 08/15/49	3,500,000.00	2,228,100.00	
T 2.25 11/15/25	4,000,000.00	3,833,400.00	
T 2.25 11/15/27	4,400,000.00	4,050,640.00	
T 2.375 02/15/42	2,800,000.00	2,000,936.00	
T 2.375 03/31/29	5,000,000.00	4,516,750.00	
T 2.375 05/15/27	3,000,000.00	2,799,660.00	
T 2.375 05/15/29	2,400,000.00	2,163,360.00	
T 2.375 05/15/51	3,900,000.00	2,524,938.00	
T 2.375 11/15/49	1,900,000.00	1,242,562.00	
T 2.5 02/15/45	1,400,000.00	982,184.00	
T 2.5 02/15/46	1,000,000.00	693,980.00	
T 2.5 02/28/26	2,100,000.00	2,009,343.00	
T 2.5 03/31/27	3,000,000.00	2,817,990.00	
T 2.5 05/15/46	1,000,000.00	691,950.00	
T 2.625 01/31/26	2,200,000.00	2,112,858.00	
T 2.625 02/15/29	1,800,000.00	1,648,818.00	
T 2.625 03/31/25	1,000,000.00	976,580.00	
T 2.625 04/15/25	4,500,000.00	4,391,010.00	
T 2.625 05/31/27	4,800,000.00	4,510,272.00	
T 2.625 07/31/29	1,100,000.00	1,000,736.00	
T 2.625 12/31/25	1,400,000.00	1,346,730.00	
T 2.75 02/15/28	5,300,000.00	4,949,246.00	
T 2.75 04/30/27	1,600,000.00	1,511,184.00	
T 2.75 05/15/25	3,000,000.00	2,925,690.00	
T 2.75 05/31/29	1,400,000.00	1,284,626.00	
T 2.75 06/30/25	900,000.00	875,529.00	
T 2.75 08/15/32	4,200,000.00	3,684,072.00	
T 2.75 08/15/42	2,000,000.00	1,509,320.00	
T 2.75 08/15/47	1,800,000.00	1,292,130.00	
T 2.75 08/31/25	3,400,000.00	3,295,858.00	

T 2.75 11/15/42	300,000.00	225,609.00	
T 2.75 11/15/47	1,500,000.00	1,074,840.00	
T 2.875 04/30/25	400,000.00	390,920.00	
T 2.875 04/30/29	3,500,000.00	3,235,435.00	
T 2.875 05/15/28	3,500,000.00	3,273,375.00	
T 2.875 05/15/32	5,700,000.00	5,063,196.00	
T 2.875 05/15/43	1,200,000.00	916,452.00	
T 2.875 05/15/49	1,400,000.00	1,019,074.00	
T 2.875 05/15/52	3,200,000.00	2,309,664.00	
T 2.875 05/31/25	3,100,000.00	3,024,298.00	
T 2.875 06/15/25	2,000,000.00	1,949,600.00	
T 2.875 08/15/28	4,500,000.00	4,196,160.00	
T 2.875 08/15/45	800,000.00	598,056.00	
T 2.875 11/15/46	3,000,000.00	2,218,710.00	
T 2.875 11/30/25	2,500,000.00	2,417,575.00	
T 3 02/15/47	2,500,000.00	1,888,325.00	
T 3 02/15/48	2,400,000.00	1,800,264.00	
T 3 02/15/49	3,300,000.00	2,464,341.00	
T 3 05/15/42	800,000.00	630,000.00	
T 3 05/15/45	900,000.00	689,022.00	
T 3 05/15/47	2,700,000.00	2,035,368.00	
T 3 07/15/25	2,000,000.00	1,950,060.00	
T 3 08/15/48	2,000,000.00	1,495,880.00	
T 3 08/15/52	3,000,000.00	2,222,280.00	
T 3 09/30/25	1,000,000.00	971,400.00	
T 3 10/31/25	2,600,000.00	2,522,182.00	
T 3 11/15/44	1,000,000.00	768,940.00	
T 3 11/15/45	800,000.00	610,120.00	
T 3.125 02/15/42	1,000,000.00	805,580.00	
T 3.125 02/15/43	2,300,000.00	1,831,904.00	
T 3.125 05/15/48	2,400,000.00	1,840,296.00	
T 3.125 08/15/25	3,000,000.00	2,925,450.00	
T 3.125 08/15/44	700,000.00	550,669.00	
T 3.125 08/31/29	2,700,000.00	2,516,481.00	
T 3.125 11/15/28	2,900,000.00	2,725,304.00	
T 3.125 11/15/41	1,000,000.00	807,850.00	
T 3.25 05/15/42	2,200,000.00	1,799,600.00	
T 3.25 06/30/29	3,000,000.00	2,818,290.00	
T 3.375 05/15/33	5,500,000.00	5,030,410.00	
T 3.375 05/15/44	500,000.00	410,175.00	
T 3.375 08/15/42	3,000,000.00	2,492,790.00	
T 3.375 11/15/48	3,100,000.00	2,483,007.00	
T 3.5 01/31/28	1,000,000.00	960,150.00	
T 3.5 01/31/30	2,500,000.00	2,365,900.00	

T 3.5 02/15/33	6,100,000.00	5,645,184.00	
T 3.5 02/15/39	200,000.00	177,074.00	
T 3.5 04/30/28	3,000,000.00	2,875,470.00	
T 3.5 04/30/30	2,500,000.00	2,361,325.00	
T 3.625 02/15/44	300,000.00	255,936.00	
T 3.625 02/15/53	1,700,000.00	1,425,161.00	
T 3.625 03/31/28	3,000,000.00	2,890,830.00	
T 3.625 03/31/30	1,200,000.00	1,142,100.00	
T 3.625 05/15/26	2,500,000.00	2,438,550.00	
T 3.625 05/15/53	2,100,000.00	1,761,648.00	
T 3.625 05/31/28	2,000,000.00	1,925,580.00	
T 3.625 08/15/43	500,000.00	427,800.00	
T 3.75 04/15/26	3,300,000.00	3,229,017.00	
T 3.75 05/31/30	3,000,000.00	2,871,420.00	
T 3.75 06/30/30	4,400,000.00	4,208,776.00	
T 3.75 08/15/41	1,100,000.00	974,952.00	
T 3.75 11/15/43	700,000.00	609,105.00	
T 3.75 12/31/28	1,000,000.00	965,130.00	
T 3.75 12/31/30	2,400,000.00	2,290,392.00	
T 3.875 01/15/26	5,300,000.00	5,203,593.00	
T 3.875 02/15/43	2,600,000.00	2,313,064.00	
T 3.875 04/30/25	1,000,000.00	987,350.00	
T 3.875 05/15/43	1,500,000.00	1,332,585.00	
T 3.875 08/15/33	6,000,000.00	5,703,720.00	
T 3.875 08/15/40	500,000.00	454,695.00	
T 3.875 09/30/29	2,300,000.00	2,224,261.00	
T 3.875 12/31/27	4,400,000.00	4,282,344.00	
T 3.875 12/31/29	1,500,000.00	1,448,610.00	
T 4 01/15/27	4,900,000.00	4,803,519.00	
T 4 01/31/29	4,100,000.00	4,000,534.00	
T 4 02/15/26	2,000,000.00	1,967,180.00	
T 4 02/15/34	4,200,000.00	4,028,052.00	
T 4 02/28/30	1,500,000.00	1,456,980.00	
T 4 02/29/28	5,000,000.00	4,885,900.00	
T 4 06/30/28	3,000,000.00	2,929,380.00	
T 4 07/31/30	2,200,000.00	2,133,472.00	
T 4 10/31/29	1,600,000.00	1,556,048.00	
T 4 11/15/42	2,000,000.00	1,814,440.00	
T 4 11/15/52	2,600,000.00	2,335,658.00	
T 4.125 02/15/27	2,000,000.00	1,966,940.00	
T 4.125 06/15/26	2,000,000.00	1,970,140.00	
T 4.125 07/31/28	1,000,000.00	981,150.00	
T 4.125 08/15/53	1,000,000.00	918,280.00	
T 4.125 08/31/30	500,000.00	488,065.00	

	T 4.125 10/31/27	3,500,000.00	3,436,335.00	
	T 4.125 11/15/32	5,600,000.00	5,437,880.00	
	T 4.25 01/31/26	3,300,000.00	3,260,037.00	
	T 4.25 02/15/54	1,000,000.00	939,290.00	
	T 4.25 02/28/29	2,500,000.00	2,466,975.00	
	T 4.25 02/28/31	1,500,000.00	1,474,215.00	
	T 4.25 03/15/27	3,900,000.00	3,849,261.00	
	T 4.25 05/15/39	100,000.00	96,210.00	
	T 4.25 10/15/25	2,000,000.00	1,977,420.00	
	T 4.25 11/15/40	600,000.00	570,492.00	
	T 4.25 12/31/25	3,500,000.00	3,458,000.00	
	T 4.375 05/15/40	900,000.00	872,226.00	
	T 4.375 05/15/41	300,000.00	288,642.00	
	T 4.375 08/15/26	4,000,000.00	3,959,600.00	
	T 4.375 08/15/43	500,000.00	475,625.00	
	T 4.375 08/31/28	1,000,000.00	990,910.00	
	T 4.375 11/15/39	300,000.00	291,654.00	
	T 4.375 11/30/28	1,900,000.00	1,883,812.00	
	T 4.375 11/30/30	1,900,000.00	1,880,430.00	
	T 4.375 12/15/26	4,000,000.00	3,960,120.00	
	T 4.5 02/15/44	1,600,000.00	1,548,992.00	
	T 4.5 05/15/38	2,000,000.00	1,993,080.00	
	T 4.5 07/15/26	3,900,000.00	3,871,257.00	
	T 4.5 08/15/39	300,000.00	296,295.00	
	T 4.5 11/15/25	3,800,000.00	3,770,132.00	
	T 4.5 11/15/33	4,500,000.00	4,490,505.00	
	T 4.625 02/15/40	1,000,000.00	998,780.00	
	T 4.625 03/15/26	2,500,000.00	2,486,600.00	
	T 4.625 09/15/26	4,000,000.00	3,982,000.00	
	T 4.625 09/30/28	2,500,000.00	2,501,950.00	
	T 4.625 09/30/30	1,500,000.00	1,505,385.00	
	T 4.625 10/15/26	1,000,000.00	995,890.00	
	T 4.625 11/15/26	4,800,000.00	4,781,040.00	
	T 4.75 02/15/41	900,000.00	908,046.00	
	T 4.75 11/15/43	700,000.00	699,342.00	
	T 4.75 11/15/53	300,000.00	306,093.00	
	T 4.875 10/31/28	1,400,000.00	1,415,610.00	
	T 5.25 11/15/28	500,000.00	513,515.00	
	T 5.375 02/15/31	320,000.00	337,062.40	
	T 6 02/15/26	1,000,000.00	1,021,090.00	
	T 6.125 11/15/27	1,000,000.00	1,048,040.00	
	アメリカ・ドル小計	632,270,000.00	555,088,675.40 (85,183,908,127)	
	CAN 0.5 09/01/25	2,700,000.00	2,561,436.00	

カナダ・ドル	CAN 1 06/01/27	800,000.00	735,344.00	
	CAN 1.25 03/01/27	400,000.00	371,360.00	
	CAN 1.25 06/01/30	800,000.00	697,064.00	
	CAN 1.5 04/01/25	300,000.00	291,336.00	
	CAN 1.5 06/01/26	2,600,000.00	2,463,760.00	
	CAN 1.5 12/01/31	2,100,000.00	1,803,732.00	
	CAN 1.75 12/01/53	1,100,000.00	740,454.00	
	CAN 2 06/01/28	700,000.00	655,599.00	
	CAN 2 06/01/32	2,000,000.00	1,771,580.00	
	CAN 2.25 06/01/25	500,000.00	487,655.00	
	CAN 2.25 06/01/29	1,100,000.00	1,032,449.00	
	CAN 2.25 12/01/29	1,600,000.00	1,494,992.00	
	CAN 2.5 12/01/32	2,930,000.00	2,684,817.60	
	CAN 2.75 06/01/33	1,800,000.00	1,676,934.00	
	CAN 2.75 09/01/27	2,600,000.00	2,513,212.00	
	CAN 2.75 12/01/48	1,300,000.00	1,126,931.00	
	CAN 2.75 12/01/55	800,000.00	681,400.00	
	CAN 3 04/01/26	400,000.00	391,224.00	
	CAN 3 10/01/25	900,000.00	882,018.00	
	CAN 3.25 12/01/33	300,000.00	290,592.00	
	CAN 3.5 03/01/34	300,000.00	296,553.00	
	CAN 3.5 08/01/25	1,300,000.00	1,283,581.00	
	CAN 3.5 12/01/45	1,200,000.00	1,183,860.00	
	CAN 4 06/01/41	1,300,000.00	1,363,635.00	
	CAN 4.5 11/01/25	1,800,000.00	1,802,538.00	
	CAN 5 06/01/37	400,000.00	456,556.00	
	CAN 5.75 06/01/29	250,000.00	275,037.50	
	CAN 5.75 06/01/33	300,000.00	348,702.00	
	CANADA 2.75 12/01/64	700,000.00	588,406.00	
カナダ・ドル小計		35,280,000.00	32,952,758.10 (3,672,584,890)	
オーストラリア・ドル	ACGB 0.25 11/21/25	1,300,000.00	1,225,302.00	
	ACGB 0.5 09/21/26	200,000.00	184,518.00	
	ACGB 1.25 05/21/32	800,000.00	640,400.00	
	ACGB 1.5 06/21/31	4,100,000.00	3,442,729.00	
	ACGB 1.75 06/21/51	500,000.00	279,590.00	
	ACGB 1.75 11/21/32	1,400,000.00	1,153,320.00	
	ACGB 2.25 05/21/28	1,300,000.00	1,221,415.00	
	ACGB 2.5 05/21/30	2,400,000.00	2,206,440.00	
	ACGB 2.75 05/21/41	600,000.00	473,916.00	
	ACGB 2.75 06/21/35	800,000.00	690,224.00	
	ACGB 2.75 11/21/27	2,400,000.00	2,311,944.00	
	ACGB 2.75 11/21/28	200,000.00	190,580.00	
	ACGB 2.75 11/21/29	1,800,000.00	1,691,838.00	

	ACGB 3 03/21/47	1,200,000.00	928,344.00	
	ACGB 3 11/21/33	900,000.00	812,196.00	
	ACGB 3.25 04/21/29	800,000.00	776,064.00	
	ACGB 3.25 06/21/39	2,000,000.00	1,734,680.00	
	ACGB 3.75 04/21/37	1,100,000.00	1,031,811.00	
	ACGB 4.25 04/21/26	2,150,000.00	2,164,663.00	
	ACGB 4.5 04/21/33	1,500,000.00	1,531,215.00	
	オーストラリア・ドル小計	27,450,000.00	24,691,189.00 (2,452,575,803)	
シンガポール・ドル	SIGB 0.5 11/01/25	200,000.00	191,070.00	
	SIGB 1.25 11/01/26	800,000.00	758,240.00	
	SIGB 1.625 07/01/31	1,000,000.00	891,000.00	
	SIGB 2.25 08/01/36	1,000,000.00	898,500.00	
	SIGB 2.625 05/01/28	800,000.00	778,080.00	
	SIGB 2.75 03/01/46	1,000,000.00	928,000.00	
	SIGB 2.75 04/01/42	700,000.00	660,891.00	
	SIGB 2.875 09/01/30	200,000.00	194,800.00	
	SIGB 3.375 09/01/33	400,000.00	400,868.00	
	SIGB 3.5 03/01/27	880,000.00	883,520.00	
	シンガポール・ドル小計	6,980,000.00	6,584,969.00 (742,652,804)	
ニュージーランド・ドル	NZGB 0.5 05/15/26	200,000.00	182,688.00	
	NZGB 1.75 05/15/41	1,200,000.00	741,276.00	
	NZGB 2 05/15/32	1,120,000.00	911,388.80	
	NZGB 2.75 04/15/25	550,000.00	536,277.50	
	NZGB 2.75 05/15/51	500,000.00	327,735.00	
	NZGB 3 04/20/29	1,000,000.00	925,000.00	
	NZGB 4.5 04/15/27	1,100,000.00	1,091,640.00	
	NZGB 4.5 05/15/30	170,000.00	168,009.30	
	ニュージーランド・ドル小計	5,840,000.00	4,884,014.60 (445,031,410)	
イギリス・ポンド	UK TSY GILT 1.125 01/31/39	600,000.00	387,156.00	
	UKT 0.125 01/30/26	1,500,000.00	1,392,480.00	
	UKT 0.125 01/31/28	1,700,000.00	1,465,842.00	
	UKT 0.25 07/31/31	1,300,000.00	994,513.00	
	UKT 0.375 10/22/26	2,000,000.00	1,816,040.00	
	UKT 0.375 10/22/30	1,400,000.00	1,113,784.00	
	UKT 0.5 01/31/29	2,050,000.00	1,737,703.00	
	UKT 0.5 10/22/61	1,200,000.00	354,336.00	
	UKT 0.625 06/07/25	600,000.00	573,594.00	
	UKT 0.625 07/31/35	1,700,000.00	1,158,907.00	
	UKT 0.875 01/31/46	400,000.00	197,908.00	
	UKT 0.875 07/31/33	1,300,000.00	979,719.00	
	UKT 0.875 10/22/29	500,000.00	423,850.00	

		UKT 1 01/31/32	2,100,000.00	1,679,286.00	
		UKT 1.125 10/22/73	300,000.00	108,828.00	
		UKT 1.25 07/22/27	900,000.00	820,998.00	
		UKT 1.25 07/31/51	1,200,000.00	583,224.00	
		UKT 1.25 10/22/41	2,700,000.00	1,648,215.00	
		UKT 1.5 07/22/26	1,100,000.00	1,034,726.00	
		UKT 1.5 07/22/47	2,000,000.00	1,123,580.00	
		UKT 1.625 10/22/28	900,000.00	812,700.00	
		UKT 1.625 10/22/54	500,000.00	260,020.00	
		UKT 1.75 01/22/49	1,950,000.00	1,139,560.50	
		UKT 1.75 09/07/37	100,000.00	74,067.00	
		UKT 2 09/07/25	1,100,000.00	1,062,017.00	
		UKT 2.5 07/22/65	1,600,000.00	1,011,024.00	
		UKT 3.25 01/22/44	1,600,000.00	1,326,512.00	
		UKT 3.25 01/31/33	2,400,000.00	2,256,048.00	
		UKT 3.5 01/22/45	1,250,000.00	1,069,775.00	
		UKT 3.5 07/22/68	1,300,000.00	1,061,112.00	
		UKT 3.5 10/22/25	700,000.00	687,890.00	
		UKT 3.75 01/29/38	1,100,000.00	1,029,930.00	
		UKT 3.75 07/22/52	1,200,000.00	1,042,212.00	
		UKT 4 01/22/60	1,300,000.00	1,178,047.00	
		UKT 4.125 01/29/27	1,700,000.00	1,690,276.00	
		UKT 4.25 03/07/36	700,000.00	700,882.00	
		UKT 4.25 06/07/32	500,000.00	508,885.00	
		UKT 4.25 09/07/39	600,000.00	588,036.00	
		UKT 4.25 12/07/27	900,000.00	903,519.00	
		UKT 4.25 12/07/40	600,000.00	584,232.00	
		UKT 4.25 12/07/46	1,500,000.00	1,428,360.00	
		UKT 4.25 12/07/49	900,000.00	853,191.00	
		UKT 4.25 12/07/55	1,700,000.00	1,607,129.00	
		UKT 4.5 09/07/34	400,000.00	411,660.00	
		UKT 4.5 12/07/42	1,050,000.00	1,046,556.00	
		UKT 4.625 01/31/34	1,400,000.00	1,456,154.00	
		UKT 4.75 12/07/30	1,150,000.00	1,201,416.50	
		UKT 4.75 12/07/38	1,000,000.00	1,039,250.00	
		UKT 6 12/07/28	650,000.00	703,859.00	
	イギリス・ポンド小計		58,300,000.00	48,329,009.00 (9,238,090,070)	
	イスラエル・シュケル	ILGOV 0.5 04/30/25	3,100,000.00	2,984,339.00	
		ILGOV 1 03/31/30	1,400,000.00	1,152,452.00	
		ILGOV 1.5 05/31/37	1,200,000.00	815,088.00	
		ILGOV 2.25 09/28/28	1,900,000.00	1,739,241.00	
		ILGOV 3.75 02/28/29	500,000.00	486,105.00	
		ILGOV 3.75 03/31/47	3,600,000.00	2,974,752.00	

	ILGOV 6.25 10/30/26	3,300,000.00	3,456,222.00	
	イスラエル・シュケル小計	**15,000,000.00**	**13,608,199.00** **(556,231,052)**	
デンマーク・クローネ	DGB 0 11/15/31	500,000.00	422,375.00	
	DGB 0.25 11/15/52	1,800,000.00	994,464.00	
	DGB 0.5 11/15/27	6,100,000.00	5,708,685.00	
	DGB 0.5 11/15/29	5,400,000.00	4,903,524.00	
	DGB 1.75 11/15/25	100,000.00	98,328.00	
	DGB 2.25 11/15/33	1,200,000.00	1,189,500.00	
	DGB 4.5 11/15/39	7,000,000.00	8,754,480.00	
	デンマーク・クローネ小計	**22,100,000.00**	**22,071,356.00** **(483,362,696)**	
ノルウェー・クローネ	NGB 1.375 08/19/30	6,800,000.00	5,945,036.00	
	NGB 1.5 02/19/26	1,700,000.00	1,626,084.00	
	NGB 1.75 02/17/27	700,000.00	661,717.00	
	NGB 1.75 09/06/29	5,000,000.00	4,542,800.00	
	NGB 2 04/26/28	5,900,000.00	5,522,341.00	
	NGB 3 08/15/33	1,100,000.00	1,040,831.00	
	NGB 3.5 10/06/42	2,300,000.00	2,325,875.00	
	ノルウェー・クローネ小計	**23,500,000.00**	**21,664,684.00** **(305,688,691)**	
スウェーデン・クローナ	SGB 0.125 05/12/31	500,000.00	427,685.00	
	SGB 0.75 05/12/28	3,700,000.00	3,457,761.00	
	SGB 0.75 11/12/29	4,200,000.00	3,853,710.00	
	SGB 1 11/12/26	6,200,000.00	5,940,778.00	
	SGB 2.5 05/12/25	5,000,000.00	4,962,550.00	
	SGB 3.5 03/30/39	5,300,000.00	5,946,070.00	
	スウェーデン・クローナ小計	**24,900,000.00**	**24,588,554.00** **(347,436,268)**	
メキシコ・ペソ	MBONO 5.5 03/04/27	15,000,000.00	13,321,500.00	
	MBONO 5.75 03/05/26	19,000,000.00	17,493,870.00	
	MBONO 7.5 05/26/33	6,000,000.00	5,173,560.00	
	MBONO 7.5 06/03/27	22,000,000.00	20,538,980.00	
	MBONO 7.75 05/29/31	29,000,000.00	25,980,520.00	
	MBONO 7.75 11/23/34	18,000,000.00	15,569,820.00	
	MBONO 8 11/07/47	13,000,000.00	10,804,430.00	
	MBONO 8.5 05/31/29	25,000,000.00	23,705,500.00	
	MBONO 8.5 11/18/38	40,000,000.00	35,846,000.00	
	メキシコ・ペソ小計	**187,000,000.00**	**168,434,180.00** **(1,556,348,668)**	
オフショア・人民元	CGB 2.18 08/15/26	22,800,000.00	22,891,656.00	
	CGB 2.18 08/25/25	39,000,000.00	39,170,430.00	
	CGB 2.24 05/25/25	31,000,000.00	31,151,900.00	
	CGB 2.28 03/25/31	13,000,000.00	12,974,130.00	
	CGB 2.3 05/15/26	17,000,000.00	17,123,760.00	

		CGB 2.35 02/25/34	10,000,000.00	10,048,800.00	
		CGB 2.37 01/15/29	17,000,000.00	17,174,420.00	
		CGB 2.39 11/15/26	65,000,000.00	65,631,800.00	
		CGB 2.4 07/15/28	41,000,000.00	41,393,190.00	
		CGB 2.46 02/15/26	29,000,000.00	29,283,620.00	
		CGB 2.48 04/15/27	9,000,000.00	9,118,800.00	
		CGB 2.5 07/25/27	13,000,000.00	13,174,070.00	
		CGB 2.52 08/25/33	11,000,000.00	11,123,200.00	
		CGB 2.54 12/25/30	27,000,000.00	27,386,910.00	
		CGB 2.55 10/15/28	11,000,000.00	11,185,240.00	
		CGB 2.6 09/15/30	32,000,000.00	32,532,480.00	
		CGB 2.62 04/15/28	27,000,000.00	27,490,860.00	
		CGB 2.62 06/25/30	22,000,000.00	22,394,020.00	
		CGB 2.62 09/25/29	19,000,000.00	19,370,880.00	
		CGB 2.64 01/15/28	31,500,000.00	32,090,625.00	
		CGB 2.67 05/25/33	5,000,000.00	5,127,600.00	
		CGB 2.67 11/25/33	15,000,000.00	15,406,050.00	
		CGB 2.69 08/12/26	50,000,000.00	50,802,000.00	
		CGB 2.8 03/24/29	26,000,000.00	26,746,980.00	
		CGB 2.8 03/25/30	15,000,000.00	15,432,600.00	
		CGB 2.8 11/15/32	21,000,000.00	21,674,520.00	
		CGB 2.88 02/25/33	10,900,000.00	11,328,915.00	
		CGB 2.91 10/14/28	21,000,000.00	21,687,120.00	
		CGB 3 10/15/53	6,000,000.00	6,649,260.00	
		CGB 3.02 05/27/31	43,000,000.00	44,991,330.00	
		CGB 3.12 10/25/52	16,000,000.00	17,606,400.00	
		CGB 3.19 04/15/53	13,000,000.00	14,694,940.00	
		CGB 3.72 04/12/51	38,700,000.00	46,860,669.00	
		オフショア・人民元小計	767,900,000.00	791,719,175.00 (16,725,384,261)	
	マレーシア・リンギット	MGS 3.502 05/31/27	5,100,000.00	5,091,891.00	
		MGS 3.582 07/15/32	2,500,000.00	2,445,125.00	
		MGS 3.757 05/22/40	1,900,000.00	1,836,312.00	
		MGS 3.9 11/30/26	1,300,000.00	1,314,313.00	
		MGS 3.955 09/15/25	3,200,000.00	3,224,480.00	
		MGS 4.498 04/15/30	4,000,000.00	4,146,200.00	
		MGS 4.504 04/30/29	700,000.00	724,822.00	
		MGS 4.696 10/15/42	1,700,000.00	1,821,329.00	
		MGS 4.736 03/15/46	6,700,000.00	7,282,632.00	
		マレーシア・リンギット小計	27,100,000.00	27,887,104.00 (896,007,074)	
	ポーランド・ズロチ	POLGB 0 10/25/25	5,000,000.00	4,624,950.00	
		POLGB 0.25 10/25/26	7,900,000.00	6,994,581.00	
		POLGB 0.75 04/25/25	1,800,000.00	1,721,772.00	

	POLGB 1.25 10/25/30	10,200,000.00	7,848,084.00	
	POLGB 2.75 04/25/28	3,000,000.00	2,723,190.00	
	POLGB 2.75 10/25/29	700,000.00	610,491.00	
	POLGB 6 10/25/33	2,000,000.00	2,049,440.00	
	ポーランド・ズロチ小計	30,600,000.00	26,572,508.00 (1,012,428,498)	
ユーロ	BGB 0 10/22/27	800,000.00	728,960.00	
	BGB 0 10/22/31	1,500,000.00	1,226,100.00	
	BGB 0.1 06/22/30	700,000.00	599,361.00	
	BGB 0.35 06/22/32	700,000.00	577,563.00	
	BGB 0.4 06/22/40	800,000.00	522,960.00	
	BGB 0.65 06/22/71	400,000.00	173,552.00	
	BGB 0.8 06/22/25	700,000.00	680,071.00	
	BGB 0.8 06/22/27	800,000.00	754,040.00	
	BGB 0.8 06/22/28	1,000,000.00	928,600.00	
	BGB 0.9 06/22/29	900,000.00	826,002.00	
	BGB 1 06/22/26	700,000.00	673,029.00	
	BGB 1 06/22/31	1,300,000.00	1,157,377.00	
	BGB 1.25 04/22/33	900,000.00	792,495.00	
	BGB 1.45 06/22/37	1,200,000.00	995,208.00	
	BGB 1.6 06/22/47	650,000.00	475,982.00	
	BGB 1.7 06/22/50	1,100,000.00	796,598.00	
	BGB 1.9 06/22/38	1,000,000.00	864,260.00	
	BGB 2.15 06/22/66	500,000.00	383,505.00	
	BGB 2.25 06/22/57	500,000.00	394,765.00	
	BGB 3 06/22/34	200,000.00	202,390.00	
	BGB 3.45 06/22/43	500,000.00	515,045.00	
	BGB 3.75 06/22/45	600,000.00	645,648.00	
	BGB 4 03/28/32	300,000.00	326,529.00	
	BGB 4.25 03/28/41	680,000.00	775,444.80	
	BGB 4.5 03/28/26	1,100,000.00	1,132,934.00	
	BGB 5 03/28/35	1,000,000.00	1,191,730.00	
	BGB 5.5 03/28/28	1,000,000.00	1,105,500.00	
	BKO 2.5 03/19/26	2,100,000.00	2,086,308.00	
	BKO 3.1 09/18/25	300,000.00	300,039.00	
	BTPS 0 08/01/26	1,300,000.00	1,208,948.00	
	BTPS 0.45 02/15/29	2,400,000.00	2,105,448.00	
	BTPS 0.5 02/01/26	1,500,000.00	1,428,060.00	
	BTPS 0.85 01/15/27	900,000.00	845,865.00	
	BTPS 0.9 04/01/31	2,000,000.00	1,691,860.00	
	BTPS 0.95 03/01/37	1,000,000.00	708,350.00	
	BTPS 0.95 06/01/32	3,300,000.00	2,710,059.00	
	BTPS 0.95 08/01/30	1,200,000.00	1,037,280.00	
	BTPS 0.95 09/15/27	800,000.00	743,520.00	

BTPS 0.95 12/01/31	2,600,000.00	2,166,034.00	
BTPS 1.1 04/01/27	1,500,000.00	1,413,210.00	
BTPS 1.25 12/01/26	800,000.00	762,096.00	
BTPS 1.45 03/01/36	400,000.00	310,356.00	
BTPS 1.45 05/15/25	700,000.00	685,594.00	
BTPS 1.5 06/01/25	1,000,000.00	979,020.00	
BTPS 1.6 06/01/26	1,200,000.00	1,160,604.00	
BTPS 1.65 12/01/30	1,100,000.00	987,063.00	
BTPS 1.7 09/01/51	1,500,000.00	928,800.00	
BTPS 1.85 07/01/25	1,000,000.00	981,800.00	
BTPS 2 02/01/28	2,500,000.00	2,397,575.00	
BTPS 2 12/01/25	1,300,000.00	1,274,013.00	
BTPS 2.05 08/01/27	1,500,000.00	1,448,985.00	
BTPS 2.1 07/15/26	1,000,000.00	976,600.00	
BTPS 2.2 06/01/27	900,000.00	874,809.00	
BTPS 2.25 09/01/36	500,000.00	422,315.00	
BTPS 2.45 09/01/33	600,000.00	545,016.00	
BTPS 2.45 09/01/50	1,700,000.00	1,250,469.00	
BTPS 2.5 11/15/25	1,200,000.00	1,185,984.00	
BTPS 2.65 12/01/27	400,000.00	393,156.00	
BTPS 2.7 03/01/47	1,250,000.00	994,087.50	
BTPS 2.8 03/01/67	700,000.00	524,125.00	
BTPS 2.8 06/15/29	1,000,000.00	978,460.00	
BTPS 2.8 12/01/28	1,300,000.00	1,278,615.00	
BTPS 2.95 02/15/27	2,500,000.00	2,483,700.00	
BTPS 2.95 09/01/38	1,000,000.00	891,610.00	
BTPS 3 08/01/29	2,600,000.00	2,568,644.00	
BTPS 3.1 03/01/40	700,000.00	625,401.00	
BTPS 3.25 03/01/38	800,000.00	740,400.00	
BTPS 3.25 09/01/46	1,600,000.00	1,401,264.00	
BTPS 3.35 03/01/35	700,000.00	674,135.00	
BTPS 3.45 03/01/48	1,000,000.00	898,930.00	
BTPS 3.5 02/15/31	1,000,000.00	1,004,350.00	
BTPS 3.5 03/01/30	1,000,000.00	1,010,900.00	
BTPS 3.7 06/15/30	1,900,000.00	1,934,808.00	
BTPS 3.85 09/01/49	1,100,000.00	1,047,904.00	
BTPS 3.85 09/15/26	2,900,000.00	2,942,978.00	
BTPS 3.85 12/15/29	1,300,000.00	1,336,231.00	
BTPS 4 02/01/37	2,000,000.00	2,034,560.00	
BTPS 4 04/30/35	500,000.00	511,790.00	
BTPS 4.1 02/01/29	700,000.00	726,642.00	
BTPS 4.4 05/01/33	2,700,000.00	2,864,592.00	
BTPS 4.5 03/01/26	1,300,000.00	1,328,730.00	
BTPS 4.75 09/01/28	1,800,000.00	1,912,410.00	

BTPS 4.75 09/01/44	1,200,000.00	1,302,792.00	
BTPS 5 08/01/34	1,570,000.00	1,741,224.20	
BTPS 5 08/01/39	1,800,000.00	1,999,854.00	
BTPS 5 09/01/40	1,700,000.00	1,889,652.00	
BTPS 5.75 02/01/33	1,700,000.00	1,972,238.00	
BTPS 6 05/01/31	2,200,000.00	2,559,546.00	
BTPS 6.5 11/01/27	1,700,000.00	1,889,788.00	
BTPS 7.25 11/01/26	400,000.00	439,420.00	
DBR 0 02/15/30	1,500,000.00	1,315,305.00	
DBR 0 02/15/32	3,200,000.00	2,682,464.00	
DBR 0 05/15/35	2,000,000.00	1,540,440.00	
DBR 0 05/15/36	800,000.00	598,976.00	
DBR 0 08/15/29	2,500,000.00	2,215,200.00	
DBR 0 08/15/30	2,500,000.00	2,169,000.00	
DBR 0 08/15/31	200,000.00	169,718.00	
DBR 0 08/15/31	2,300,000.00	1,952,792.00	
DBR 0 08/15/50	3,000,000.00	1,583,280.00	
DBR 0 08/15/50	1,300,000.00	688,506.00	
DBR 0 11/15/27	1,300,000.00	1,192,659.00	
DBR 0 11/15/28	400,000.00	359,924.00	
DBR 0.25 02/15/27	300,000.00	281,439.00	
DBR 0.25 02/15/29	1,200,000.00	1,088,160.00	
DBR 0.25 08/15/28	1,500,000.00	1,371,915.00	
DBR 0.5 02/15/26	3,200,000.00	3,068,992.00	
DBR 0.5 02/15/28	1,600,000.00	1,490,320.00	
DBR 0.5 08/15/27	2,100,000.00	1,969,884.00	
DBR 1 05/15/38	1,600,000.00	1,318,352.00	
DBR 1 08/15/25	1,900,000.00	1,848,168.00	
DBR 1.25 08/15/48	1,650,000.00	1,279,063.50	
DBR 1.7 08/15/32	2,400,000.00	2,293,704.00	
DBR 1.8 08/15/53	200,000.00	171,494.00	
DBR 1.8 08/15/53	1,500,000.00	1,288,050.00	
DBR 2.1 11/15/29	1,400,000.00	1,383,396.00	
DBR 2.3 02/15/33	1,600,000.00	1,599,152.00	
DBR 2.3 02/15/33	1,300,000.00	1,299,727.00	
DBR 2.4 11/15/30	1,100,000.00	1,105,764.00	
DBR 2.5 07/04/44	1,600,000.00	1,591,120.00	
DBR 2.5 08/15/46	2,700,000.00	2,692,008.00	
DBR 3.25 07/04/42	1,000,000.00	1,103,330.00	
DBR 4 01/04/37	1,300,000.00	1,516,476.00	
DBR 4.25 07/04/39	700,000.00	852,264.00	
DBR 4.75 07/04/28	1,600,000.00	1,748,656.00	
DBR 4.75 07/04/34	600,000.00	728,556.00	
DBR 4.75 07/04/40	1,450,000.00	1,875,821.50	

DBR 5.5 01/04/31	900,000.00	1,075,500.00	
DBR 5.625 01/04/28	1,000,000.00	1,111,310.00	
DBR 6.25 01/04/30	800,000.00	965,248.00	
DBR 6.5 07/04/27	1,000,000.00	1,120,450.00	
FRTR 0 02/25/26	2,000,000.00	1,894,420.00	
FRTR 0 02/25/27	1,100,000.00	1,017,291.00	
FRTR 0 05/25/32	2,900,000.00	2,327,917.00	
FRTR 0 11/25/29	3,500,000.00	3,021,550.00	
FRTR 0 11/25/30	3,600,000.00	3,022,380.00	
FRTR 0 11/25/31	3,000,000.00	2,446,170.00	
FRTR 0.25 11/25/26	2,900,000.00	2,716,691.00	
FRTR 0.5 05/25/25	1,300,000.00	1,260,532.00	
FRTR 0.5 05/25/26	3,100,000.00	2,951,324.00	
FRTR 0.5 05/25/29	3,000,000.00	2,694,300.00	
FRTR 0.5 05/25/40	1,300,000.00	872,495.00	
FRTR 0.5 05/25/72	100,000.00	39,600.00	
FRTR 0.5 06/25/44	1,200,000.00	727,368.00	
FRTR 0.75 02/25/28	4,200,000.00	3,904,404.00	
FRTR 0.75 05/25/28	3,100,000.00	2,870,693.00	
FRTR 0.75 05/25/52	3,000,000.00	1,639,380.00	
FRTR 0.75 11/25/28	3,400,000.00	3,121,200.00	
FRTR 1 05/25/27	2,000,000.00	1,897,580.00	
FRTR 1 11/25/25	800,000.00	774,504.00	
FRTR 1.25 05/25/34	1,200,000.00	1,031,256.00	
FRTR 1.25 05/25/36	2,750,000.00	2,270,592.50	
FRTR 1.25 05/25/38	900,000.00	712,854.00	
FRTR 1.5 05/25/31	3,050,000.00	2,817,559.50	
FRTR 1.5 05/25/50	2,400,000.00	1,669,920.00	
FRTR 1.75 05/25/66	800,000.00	545,144.00	
FRTR 1.75 06/25/39	2,700,000.00	2,272,023.00	
FRTR 2 05/25/48	2,000,000.00	1,589,760.00	
FRTR 2 11/25/32	2,700,000.00	2,540,214.00	
FRTR 2.5 05/25/30	2,600,000.00	2,575,430.00	
FRTR 2.5 05/25/43	3,000,000.00	2,695,740.00	
FRTR 2.5 09/24/26	4,600,000.00	4,563,154.00	
FRTR 2.75 02/25/29	1,100,000.00	1,103,201.00	
FRTR 2.75 10/25/27	2,650,000.00	2,652,120.00	
FRTR 3 05/25/33	1,500,000.00	1,521,555.00	
FRTR 3.25 05/25/45	900,000.00	906,237.00	
FRTR 3.5 04/25/26	1,800,000.00	1,821,006.00	
FRTR 3.5 11/25/33	2,400,000.00	2,528,496.00	
FRTR 4 04/25/55	1,370,000.00	1,553,251.20	
FRTR 4 04/25/60	1,400,000.00	1,608,740.00	
FRTR 4 10/25/38	2,000,000.00	2,215,600.00	

FRTR 4.5 04/25/41	1,900,000.00	2,239,435.00	
FRTR 4.75 04/25/35	800,000.00	936,112.00	
FRTR 5.5 04/25/29	1,650,000.00	1,863,889.50	
FRTR 5.75 10/25/32	400,000.00	488,268.00	
FRTR 6 10/25/25	2,100,000.00	2,188,998.00	
IRISH 0 10/18/31	500,000.00	411,875.00	
IRISH 0.9 05/15/28	500,000.00	468,150.00	
IRISH 1 05/15/26	1,000,000.00	963,830.00	
IRISH 1.1 05/15/29	500,000.00	465,155.00	
IRISH 1.3 05/15/33	500,000.00	444,970.00	
IRISH 1.35 03/18/31	500,000.00	461,645.00	
IRISH 1.5 05/15/50	500,000.00	364,860.00	
IRISH 1.7 05/15/37	300,000.00	261,507.00	
IRISH 2 02/18/45	1,100,000.00	932,558.00	
IRISH 2.4 05/15/30	600,000.00	593,604.00	
IRISH 2.6 10/18/34	300,000.00	295,335.00	
NETHER 0 01/15/27	1,300,000.00	1,210,066.00	
NETHER 0 07/15/30	2,200,000.00	1,883,134.00	
NETHER 0.25 07/15/25	930,000.00	897,561.60	
NETHER 0.25 07/15/29	500,000.00	444,955.00	
NETHER 0.5 01/15/40	1,500,000.00	1,076,835.00	
NETHER 0.5 07/15/26	1,300,000.00	1,237,171.00	
NETHER 0.5 07/15/32	1,700,000.00	1,442,688.00	
NETHER 0.75 07/15/27	400,000.00	377,404.00	
NETHER 0.75 07/15/28	1,700,000.00	1,578,909.00	
NETHER 2.5 01/15/33	600,000.00	596,448.00	
NETHER 2.5 07/15/33	500,000.00	496,090.00	
NETHER 2.75 01/15/47	2,300,000.00	2,322,770.00	
NETHER 3.25 01/15/44	200,000.00	215,716.00	
NETHER 3.75 01/15/42	1,300,000.00	1,482,312.00	
NETHER 4 01/15/37	300,000.00	341,199.00	
NETHER 5.5 01/15/28	700,000.00	771,589.00	
OBL 0 04/10/26	2,100,000.00	1,989,435.00	
OBL 0 04/16/27	2,200,000.00	2,041,776.00	
OBL 0 10/09/26	2,700,000.00	2,531,979.00	
OBL 0 10/10/25	2,600,000.00	2,489,552.00	
OBL 1.3 10/15/27	300,000.00	288,588.00	
OBL 2.2 04/13/28	600,000.00	595,272.00	
OBL 2.4 10/19/28	1,600,000.00	1,600,944.00	
RAGB 0 02/20/30	1,300,000.00	1,114,048.00	
RAGB 0 02/20/31	1,400,000.00	1,165,108.00	
RAGB 0 04/20/25	230,000.00	222,587.10	
RAGB 0 10/20/40	300,000.00	183,690.00	
RAGB 0.5 02/20/29	550,000.00	496,457.50	

RAGB 0.5 04/20/27	700,000.00	655,060.00	
RAGB 0.75 02/20/28	600,000.00	558,564.00	
RAGB 0.75 03/20/51	900,000.00	533,493.00	
RAGB 0.75 10/20/26	600,000.00	571,074.00	
RAGB 0.85 06/30/20	250,000.00	114,677.50	
RAGB 0.9 02/20/32	1,000,000.00	869,950.00	
RAGB 1.2 10/20/25	1,000,000.00	972,980.00	
RAGB 1.5 02/20/47	700,000.00	524,818.00	
RAGB 1.5 11/02/86	400,000.00	246,108.00	
RAGB 2.4 05/23/34	1,000,000.00	961,870.00	
RAGB 2.9 02/20/33	500,000.00	503,375.00	
RAGB 3.15 06/20/44	500,000.00	508,210.00	
RAGB 3.8 01/26/62	700,000.00	815,815.00	
RAGB 4.15 03/15/37	300,000.00	338,097.00	
RAGB 4.85 03/15/26	800,000.00	828,720.00	
RAGB 6.25 07/15/27	1,000,000.00	1,108,080.00	
RFGB 0 09/15/26	300,000.00	280,479.00	
RFGB 0 09/15/30	400,000.00	337,696.00	
RFGB 0.25 09/15/40	700,000.00	452,984.00	
RFGB 0.5 04/15/26	700,000.00	667,800.00	
RFGB 0.5 09/15/27	500,000.00	464,400.00	
RFGB 0.5 09/15/28	300,000.00	273,168.00	
RFGB 0.5 09/15/29	800,000.00	714,400.00	
RFGB 0.75 04/15/31	800,000.00	701,912.00	
RFGB 1.375 04/15/47	500,000.00	368,285.00	
RFGB 2.625 07/04/42	800,000.00	757,784.00	
RFGB 2.75 04/15/38	200,000.00	194,298.00	
RFGB 2.75 07/04/28	200,000.00	200,824.00	
RFGB 4 07/04/25	300,000.00	302,892.00	
SPGB 0 01/31/27	500,000.00	461,260.00	
SPGB 0 05/31/25	2,600,000.00	2,505,100.00	
SPGB 0.5 04/30/30	1,600,000.00	1,393,312.00	
SPGB 0.5 10/31/31	1,400,000.00	1,170,904.00	
SPGB 0.7 04/30/32	2,000,000.00	1,676,620.00	
SPGB 0.8 07/30/27	1,700,000.00	1,590,588.00	
SPGB 0.8 07/30/29	700,000.00	630,238.00	
SPGB 0.85 07/30/37	800,000.00	584,856.00	
SPGB 1 10/31/50	800,000.00	443,712.00	
SPGB 1.2 10/31/40	1,400,000.00	993,818.00	
SPGB 1.25 10/31/30	2,100,000.00	1,896,510.00	
SPGB 1.3 10/31/26	1,400,000.00	1,344,714.00	
SPGB 1.4 04/30/28	2,000,000.00	1,891,820.00	
SPGB 1.4 07/30/28	1,200,000.00	1,132,236.00	
SPGB 1.45 04/30/29	2,100,000.00	1,966,482.00	

		SPGB 1.45 10/31/27	1,800,000.00	1,716,138.00	
		SPGB 1.45 10/31/71	400,000.00	201,196.00	
		SPGB 1.5 04/30/27	1,500,000.00	1,440,180.00	
		SPGB 1.6 04/30/25	1,400,000.00	1,375,472.00	
		SPGB 1.85 07/30/35	600,000.00	522,090.00	
		SPGB 1.95 04/30/26	2,400,000.00	2,349,336.00	
		SPGB 1.95 07/30/30	700,000.00	663,397.00	
		SPGB 2.15 10/31/25	1,600,000.00	1,577,264.00	
		SPGB 2.35 07/30/33	700,000.00	658,413.00	
		SPGB 2.55 10/31/32	1,600,000.00	1,542,320.00	
		SPGB 2.7 10/31/48	750,000.00	634,717.50	
		SPGB 2.8 05/31/26	1,100,000.00	1,094,577.00	
		SPGB 2.9 10/31/46	1,700,000.00	1,511,164.00	
		SPGB 3.15 04/30/33	2,200,000.00	2,211,176.00	
		SPGB 3.45 07/30/43	700,000.00	682,094.00	
		SPGB 3.45 07/30/66	1,300,000.00	1,205,659.00	
		SPGB 3.55 10/31/33	1,500,000.00	1,550,925.00	
		SPGB 3.9 07/30/39	700,000.00	732,179.00	
		SPGB 4.2 01/31/37	1,050,000.00	1,144,395.00	
		SPGB 4.65 07/30/25	800,000.00	813,984.00	
		SPGB 4.7 07/30/41	1,500,000.00	1,723,800.00	
		SPGB 4.9 07/30/40	1,400,000.00	1,634,038.00	
		SPGB 5.15 10/31/28	1,500,000.00	1,647,180.00	
		SPGB 5.15 10/31/44	1,400,000.00	1,708,812.00	
		SPGB 5.75 07/30/32	1,000,000.00	1,199,600.00	
		SPGB 5.9 07/30/26	500,000.00	531,360.00	
		SPGB 6 01/31/29	1,900,000.00	2,169,344.00	
	ユーロ小計		376,780,000.00	352,290,171.40 (57,564,214,007)	
国債証券合計				181,181,944,320 (181,181,944,320)	
合　計				181,181,944,320 (181,181,944,320)	

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

通　貨	銘柄数		組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券	241銘柄	46.3%	47.0%
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	20銘柄	1.3%	1.4%
シンガポール・ドル	国債証券	10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	49銘柄	5.0%	5.1%
イスラエル・シュケル	国債証券	7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	7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	9銘柄	0.8%	0.9%
オフショア・人民元	国債証券	33銘柄	9.1%	9.2%
マレーシア・リンギット	国債証券	9銘柄	0.5%	0.5%
ポーランド・ズロチ	国債証券	7銘柄	0.6%	0.6%
ユーロ	国債証券	285銘柄	31.3%	31.8%

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

マネーインカム・マザーファンド

（１）貸借対照表

（単位：円）

	（2024年4月15日現在）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	12,483,776
コール・ローン	589,788,318
国債証券	270,503,100
特殊債券	1,001,717,500
未収利息	1,297,039
前払費用	16,033
流動資産合計	1,875,805,766
資産合計	1,875,805,766
負債の部	
流動負債	
未払解約金	4,099,999
流動負債合計	4,099,999
負債合計	4,099,999
純資産の部	
元本等	
元本	1,858,052,855
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	13,652,912
元本等合計	1,871,705,767
純資産合計	1,871,705,767
負債純資産合計	1,875,805,766

（２）注記表

（重要な会計方針の注記）

項　目	自 2023年4月14日 至 2024年4月15日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、特殊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。 (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。

	(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。 (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。

（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	（2024年4月15日現在）
１．　当計算期間の末日における受益権の総数	1,858,052,855口
２．　１単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　1.0073円 （１万口当たりの純資産額10,073円）

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	自 2023年4月14日 至 2024年4月15日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、特殊債券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

３．　金融商品に係るリスク管理体制	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。 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、上下限値、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。 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。

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	（2024年4月15日現在）
１．　貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券、特殊債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
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 2023年4月14日 至 2024年4月15日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

（2024年4月15日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	1,989,263,317円
同期中における追加設定元本額	1,108,055,562円
同期中における一部解約元本額	1,239,266,024円
2024年4月15日現在の元本の内訳	
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	25,629,854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）	96,450,922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）	259,215,540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）	201,333,396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）	59,215,119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）	44,151,579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）	70,837,458円
米国小型ハイクオリティファンド（毎月決算型）	99,128円
米国小型ハイクオリティファンド（資産成長型）	297,384円
ＳＭＡＭ・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	752,116,239円
ＳＭＡＭ・ＦＧマネーファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	348,706,236円
合　計	1,858,052,855円

（３）附属明細表

①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	３３５　１０年国債	120,000,000	120,249,600	
	３３７　１０年国債	150,000,000	150,253,500	
	国債証券　小計		270,503,100	
特殊債券	２１５　政保道路機構	200,000,000	200,098,400	
	２１８　政保道路機構	100,000,000	100,149,500	
	２２０　政保道路機構	200,000,000	200,449,200	
	２２２　政保道路機構	100,000,000	100,250,600	
	２２５　政保道路機構	100,000,000	100,233,800	
	６０政保地方公共団	100,000,000	100,113,600	
	６４政保地方公共団	100,000,000	100,211,200	
	３１　政保日本政策	100,000,000	100,211,200	
	特殊債券　小計		1,001,717,500	
合　計			1,272,220,600	

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ）

2024年4月30日現在

Ⅰ　資産総額	2,579,503,746円
Ⅱ　負債総額	1,881,721円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	2,577,622,025円
Ⅳ　発行済口数	1,122,142,355口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ） （１万口当たり純資産額）	2.2971円 （22,971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た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4月30日現在
資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060株

ロ　最近５年間における資本金の額の増減

該当ありません。

ハ　会社の機構

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

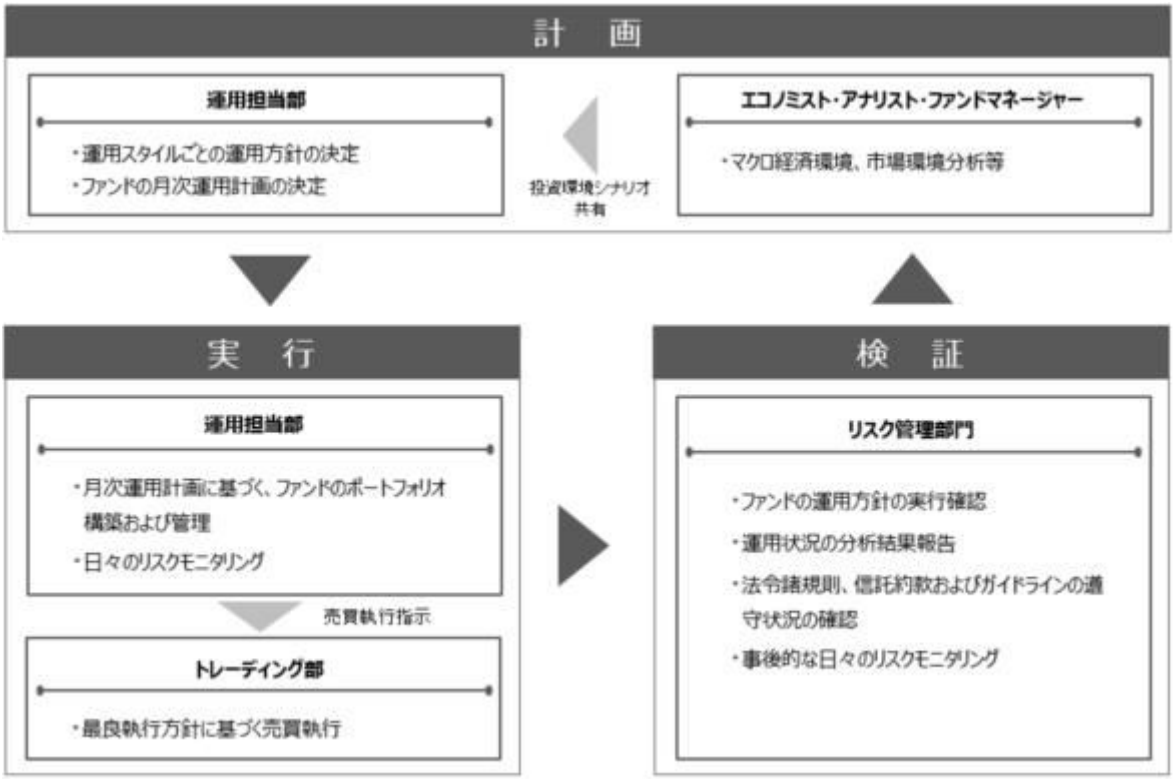
取締役の任期は、選任後１年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

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

ニ　投資信託の運用の流れ



２【事業の内容及び営業の概況】

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

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

2024年4月30日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

	本　数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	684	12,549,463
単位型株式投資信託	92	654,126
追加型公社債投資信託	1	24,895
単位型公社債投資信託	154	243,251
合　計	931	13,471,736

3【委託会社等の経理状況】

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

2　当社は、当事業年度（2023年4月1日から2024年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

（単位：千円）

		前事業年度 （2023年3月31日）	当事業年度 （2024年3月31日）
資産の部			
流動資産			
現金及び預金		37,742,400	66,540,261
金銭の信託		12,645,575	23,435,831
顧客分別金信託		300,046	300,051
前払費用		546,900	583,635
未収入金		437,880	193,837
未収委託者報酬		11,563,662	14,480,419
未収運用受託報酬		2,138,030	3,342,186
未収投資助言報酬		344,586	406,420
未収収益		35,477	84,166
その他の流動資産		8,423	43,391
流動資産合計		65,762,982	109,410,202
固定資産			
有形固定資産	※1		
建物		1,361,305	1,265,924
器具備品		559,057	516,485
土地		710	710
リース資産		4,114	1,782
建設仮勘定		81,240	-

有形固定資産合計	2,006,427	1,784,901
無形固定資産		
ソフトウェア	2,414,295	2,606,617
ソフトウェア仮勘定	508,956	101,101
のれん	3,045,409	2,740,868
顧客関連資産	11,445,340	9,332,065
電話加入権	12,706	12,706
商標権	36	30
無形固定資産合計	17,426,744	14,793,389
投資その他の資産		
投資有価証券	9,222,276	9,976,957
関係会社株式	11,850,598	1,927,221
長期差入保証金	1,388,987	1,361,654
長期前払費用	80,207	44,009
会員権	90,479	90,479
繰延税金資産	-	716,093
貸倒引当金	△ 20,750	△ 20,750
投資その他の資産合計	22,611,799	14,095,666
固定資産合計	42,044,971	30,673,957
資産合計	107,807,953	140,084,160

（単位：千円）

	前事業年度 （2023年3月31日）	当事業年度 （2024年3月31日）
負債の部		
流動負債		
リース債務	2,564	1,960
顧客からの預り金	11,094	21,728
その他の預り金	128,069	166,944
未払金		
未払収益分配金	2,013	1,927
未払償還金	1,312	1,253
未払手数料	5,194,011	6,580,971
その他未払金	259,542	642,514
未払費用	6,370,986	7,405,559
未払消費税等	406,770	937,155
未払法人税等	333,009	5,104,541
賞与引当金	1,801,492	2,854,060
資産除去債務	13,940	-
その他の流動負債	73,657	17,443
流動負債合計	14,598,465	23,736,060
固定負債		
リース債務	1,960	-
繰延税金負債	550,493	-
退職給付引当金	5,027,832	4,941,989
固定負債合計	5,580,287	4,941,989
負債合計	20,178,752	28,678,050
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	3,391,568	27,075,963
利益剰余金合計	3,675,814	27,360,208
株主資本計	87,771,760	111,456,155
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	△ 142,558	△ 50,045
評価・換算差額等合計	△ 142,558	△ 50,045
純資産合計	87,629,201	111,406,109
負債・純資産合計	107,807,953	140,084,160

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	前事業年度 （自　2022年4月1日 至　2023年3月31日）	当事業年度 （自　2023年4月1日 至　2024年3月31日）
営業収益		
委託者報酬	61,471,271	69,953,226
運用受託報酬	8,978,419	11,147,187
投資助言報酬	1,273,386	1,302,916
その他営業収益		
サービス支援手数料	208,222	319,553
その他	22,995	8,758
営業収益計	71,954,296	82,731,642
営業費用		
支払手数料	28,036,456	32,014,851
広告宣伝費	294,588	320,694
調査費		
調査費	3,749,357	4,637,211
委託調査費	11,455,987	12,412,033
営業雑経費		
通信費	61,068	56,291
印刷費	452,951	457,187
協会費	38,701	38,305
諸会費	33,447	30,484
情報機器関連費	5,067,617	5,268,275
販売促進費	29,621	31,339
その他	197,696	253,344
営業費用合計	49,417,495	55,520,019
一般管理費		
給料		
役員報酬	219,872	232,329
給料・手当	7,807,797	8,043,456
賞与	1,042,472	1,073,375
賞与引当金繰入額	1,798,492	2,854,060
交際費	27,713	57,134
寄付金	25,518	26,400
事務委託費	1,727,189	2,022,734
旅費交通費	99,733	166,596
租税公課	352,030	600,468
不動産賃借料	1,268,303	1,249,392
退職給付費用	624,551	712,228
固定資産減価償却費	3,247,869	3,281,572

のれん償却費	304,540	304,540
諸経費	200,758	215,455
一般管理費合計	18,746,845	20,839,745
営業利益	3,789,956	6,371,877

（単位：千円）

		前事業年度 （自　2022年4月1日 至　2023年3月31日）	当事業年度 （自　2023年4月1日 至　2024年3月31日）
営業外収益			
受取配当金		1,755	11,021,392
受取利息		1,373	2,840
金銭の信託運用益		-	199,056
時効成立分配金・償還金		521	461
原稿・講演料		2,281	2,143
投資有価証券償還益		119,033	5,384
投資有価証券売却益		25,848	12,261
為替差益		5,816	-
雑収入		91,814	129,137
営業外収益合計		248,443	11,372,678
営業外費用			
金銭の信託運用損		454,339	-
投資有価証券償還損		83,598	10,829
投資有価証券売却損		152,691	48,575
為替差損		-	4,701
営業外費用合計		690,629	64,106
経常利益		3,347,770	17,680,450
特別利益			
子会社株式売却益	※1	-	14,096,622
特別利益合計		-	14,096,622
特別損失			
固定資産除却損	※2	13,203	12,385
早期退職費用	※3	126,832	-
支払補償費	※4	30,075	-
特別損失合計		170,111	12,385
税引前当期純利益		3,177,659	31,764,687
法人税、住民税及び事業税		1,622,064	7,802,794
法人税等調整額		△ 541,433	△ 1,314,394
法人税等合計		1,080,631	6,488,400
当期純利益		2,097,028	25,276,287

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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	
			その他資本	資本剰余金		その他利益剰余金

		資本準備金	剰余金	合計	利益準備金	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

当事業年度（自　2023年4月1日　至　2024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	3,391,568
当期変動額						
剰余金の配当						△ 1,591,892
当期純利益						25,276,287
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	－	－	－	－	－	23,684,394
当期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	27,075,963

	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
当期変動額					
剰余金の配当	△ 1,591,892	△ 1,591,892			△ 1,591,892
当期純利益	25,276,287	25,276,287			25,276,287
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）			92,513	92,513	92,513

当期変動額合計	23,684,394	23,684,394	92,513	92,513	23,776,908
当期末残高	27,360,208	111,456,155	△ 50,045	△ 50,045	111,406,109

[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

①子会社株式

移動平均法による原価法

②その他有価証券

市場価格のない株式等以外

決算日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

投資事業有限責任組合及びそれに類する組合への出資（金融商品取引法第2条第2項により有価証券とみなされるもの）

組合契約に規定される決算報告日に応じて入手可能な最近の決算書を基礎とし、持分相当額を純額で取り込む方法によっております。

(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	**8～30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。

①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。

②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。

(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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
建物	301,463千円	397,568千円
器具備品	1,499,284千円	1,493,885千円
リース資産	7,493千円	9,824千円

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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024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

前事業年度は、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。

当事業年度は、該当事項はありません。

	前事業年度 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
Sumitomo Mitsui DS Asset Management (USA)Inc.	12,514千円	－千円

(損益計算書関係)

※1　子会社売却益

日興グローバルラップ株式会社の株式を譲渡したことによる売却益であります。

※2　固定資産除却損

	前事業年度 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	当事業年度 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
建物	2,482千円	9,039千円
器具備品	4,273千円	2,987千円
リース資産	532千円	－千円
ソフトウェア	5,915千円	358千円

※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 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

当事業年度(自 2023年4月1日　至 2024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
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

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
2024年6月26日 定時株主総会	普通株式	10,838,419	320.00	2024年3月31日	2024年6月27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（2023年3月31日）	当事業年度（2024年3月31日）
1年以内	1,161,545	1,161,545
1年超	1,161,545	-
合計	2,323,090	1,161,545

(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、資金調達は行っておりません。

(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

①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。

②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（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			
①その他有価証券	9,182,466	9,182,466	－
資産計	21,828,042	21,828,042	－

当事業年度（2024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	23,435,831	23,435,831	－
(2)投資有価証券			
①その他有価証券	9,292,678	9,292,678	－
資産計	32,728,510	32,728,510	－

(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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
その他有価証券		
(1)非上場株式	39,809	40,370
(2)組合出資金等	-	643,909
合計	39,809	684,279

子会社株式 非上場株式	11,850,598	1,927,221
合計	11,850,598	1,927,221

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

前事業年度（2023年3月31日）　（単位：千円）

区分	時価			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
(1)金銭の信託	－	12,645,575	－	12,645,575
(2)投資有価証券				
①その他有価証券	－	9,182,466	－	9,182,466
資産計	－	21,828,042	－	21,828,042

当事業年度（2024年3月31日）　（単位：千円）

区分	時価			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
(1)金銭の信託	－	23,435,831	－	23,435,831
(2)投資有価証券				
①その他有価証券	－	9,292,678	－	9,292,678
資産計	－	32,728,510	－	32,728,510

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①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（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。

当事業年度（2024年3月31日）

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

２.その他有価証券

前事業年度（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。

当事業年度（2024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	3,489,939	3,297,367	192,572
小計	3,489,939	3,297,367	192,572
(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	5,802,739	6,025,562	△222,822
小計	5,802,739	6,025,562	△222,822
合計	9,292,678	9,322,929	△30,250

（注）非上場株式等（貸借対照表計上額　684,279千円）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 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

当事業年度(自 2023年4月1日　至 2024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
801,686	12,261	48,575

（単位：千円）

償還額	償還益の合計額	償還損の合計額
217,908	5,384	10,829

(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 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	当事業年度 （自 2023年4月１日 至 2024年3月31日）
退職給付債務の期首残高	5,084,506	5,027,832
勤務費用	429,188	423,516
利息費用	6,502	11,432
数理計算上の差異の発生額	△12,781	△34,405
退職給付の支払額	△479,583	△466,321
過去勤務費用の発生額	－	△20,064
退職給付債務の期末残高	5,027,832	4,941,989

(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 （2023年3月31日）	当事業年度 （2024年3月31日）
非積立型制度の退職給付債務	5,027,832	4,941,989
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	5,027,832	4,941,989

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

（単位：千円）

	前事業年度 （自 2022年4月１日 至 2023年3月31日）	当事業年度 （自 2023年4月１日 至 2024年3月31日）
勤務費用	429,188	423,516
利息費用	6,502	11,432
数理計算上の差異の費用処理額	△12,781	△34,405
過去勤務費用の費用処理額	―	△20,064
その他	△39,914	67,197
確定給付制度に係る退職給付費用	382,994	447,675

（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 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	当事業年度 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
割引率	0.230%	0.440%

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241,556千円、当事業年度264,552千円であります。

(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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	1,539,522	1,513,237
賞与引当金	551,617	873,913
調査費	473,972	558,908
未払金	211,439	176,993
未払事業税	39,995	365,090
ソフトウェア償却	105,506	101,113
子会社株式評価損	114,876	114,876
その他有価証券評価差額金	120,350	109,942
その他	21,158	18,064
繰延税金資産小計	3,178,439	3,832,139
評価性引当額	△ 193,662	△198,503
繰延税金資産合計	2,984,776	3,633,635
繰延税金負債		
無形固定資産	3,504,563	2,857,478
資産除去債務	3,201	-
その他有価証券評価差額金	27,506	60,063
繰延税金負債合計	3,535,270	2,917,542
繰延税金資産（負債）の純額	△550,493	716,093

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 (2023年3月31日)	当事業年度 (2024年3月31日)
法定実効税率	30.6%	30.6%

（調整）

受取配当等永久に益金に算入されない項目	△0.0	△10.6
のれん償却費	2.9	0.2
交際費等永久に損金に算入されない項目	3.0	0.1
所得税額控除による税額控除	△1.3	-
その他	△1.2	0.0
税効果会計適用後の法人税等の負担率	34.0	20.4

(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 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

①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。

②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 2023年4月1日 至2024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	69,953,226	11,147,187	1,302,916	328,311	82,731,642

(2)地域ごとの情報

①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。

②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 2022年4月1日　至 2023年3月31日)

１．関連当事者との取引

(1)兄弟会社等

（単位：千円）

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

（注）取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

２．親会社に関する注記

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

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

１．関連当事者との取引

(1)兄弟会社等

（単位：千円）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の子会社	㈱三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	—%	投信の販売委託役員の兼任	委託販売手数料	6,642,605	未払手数料	1,630,250
親会社の子会社	SMBC日興証券㈱	東京都千代田区	135,000,000	証券業	—%	投信の販売委託役員の兼任	委託販売手数料	6,960,278	未払手数料	1,200,878

（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

（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	㈱三井住友フィナンシャルグループ	東京都千代田区	2,344,038,000	銀行業	50.1%	持株会社	子会社株式の売却（売却価格）	24,000,000	－	－
							子会社株式売却益	14,096,622		

（注）子会社株式の売却及び子会社株式売却益
取引価額については、企業価値を勘案し、両社協議のうえ合理的に決定しております。

(１株当たり情報)

	前事業年度 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	当事業年度 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
1株当たり純資産額	2,587.21円	3,289.22円
1株当たり当期純利益	61.91円	746.27円

（注）1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。
2. １株当たり当期純利益の算定上の基礎は、次のとおりであります。

	前事業年度 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	当事業年度 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
1株当たり当期純利益		
当期純利益（千円）	2,097,028	25,276,287
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）	2,097,028	25,276,287
期中平均株式数（株）	33,870,060	33,870,060

４【利害関係人との取引制限】

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

イ　自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

ロ　運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

ハ　通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

ニ　委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

ホ　上記ハ、ニに掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

５【その他】

イ　定款の変更、その他の重要事項

（イ）定款の変更

該当ありません。

（ロ）その他の重要事項

該当ありません。

ロ　訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実

該当ありません。

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

イ　受託会社

（イ）名称　三井住友信託銀行株式会社

（ロ）資本金の額　342,037百万円（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
ａｕ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ＳＢＩ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。
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。
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。
ＳＭＢＣ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。
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。
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旨を記載することがあります。

（８）「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載をすることがあります。

（９）当ファンドのロゴおよび委託会社のロゴを記載することがあります。

（10）ファンドの形態および属性、申込みにかかる事項、ユニバーサルデザインフォントマークを記載することがあります。

（11）写真、イラスト、図案およびキャッチコピーを採用することがあります。また、ファンドの管理番号等を記載することがあります。

２　目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。

３　当ファンドの投資信託約款の全文を請求目論見書に掲載することがあります。

４　目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」と称して使用することがあります。

５　評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。

６　有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドの実質的な投資対象資産に共通性がある場合には、当該複数のファンドを一つの投資信託説明書（交付目論見書）で説明することがあります。また、有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドにかかる投資信託説明書（交付目論見書）および投資信託説明書（請求目論見書）を一体のものとして使用することがあります。

独立監査人の監査報告書

2024年６月14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

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2024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．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 監 査 報 告 書

2024年7月3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

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ターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ）の2023年4月14日から2024年4月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０４０（４資産タイプ）の2024年4月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

その他の記載内容
その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。
当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。
財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。
当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。
その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任
監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。
・　不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立

案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

利害関係

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

以　上

―――

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