

## 【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12月5日提出
【発行者名】	三井住友D S アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 猿田 隆
【本店の所在の場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【事務連絡者氏名】	竹本 政司
【電話番号】	03-6205-0265
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

## (1)【ファンドの名称】

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

## (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

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

## (3)【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

## (4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

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

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

## (5)【申込手数料】

ありません。

## (6)【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

( 7 ) 【申込期間】

2024年12月6日から2025年6月5日まで

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

( 8 ) 【申込取扱場所】

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

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

( 9 ) 【払込期日】

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

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

( 1 0 ) 【払込取扱場所】

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

( 1 1 ) 【振替機関に関する事項】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

( 1 2 ) 【その他】

イ 申込証拠金  
ありません。

ロ 日本以外の地域における募集  
ありません。

ハ お申込不可日

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

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

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

ホ 振替受益権について

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

よび当該振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。

(参考：投資信託振替制度)

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

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

ベンチマークの詳細については、後述の「2 投資方針」をご参照ください。

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

ハ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング			
-----------------------------------	--	--------	--	--	--

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分の「為替ヘッジ」は、対円で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。

商品分類および属性区分は、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。

商品分類および属性区分の用語の定義については下記をご覧ください。なお、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<https://www.toushin.or.jp/>) でもご覧頂けます。

## 一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」

### 商品分類表定義

#### 1. 単位型投信・追加型投信の区分

- (1) 単位型投信... 当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいう。
- (2) 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う。

#### 2. 投資対象地域による区分

- (1) 国内... 目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 海外... 目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 内外... 目論見書または投資信託約款において、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う。

#### 3. 投資対象資産（収益の源泉）による区分

- (1) 株式... 目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 債券... 目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 不動産投信（リート）... 目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4) その他資産... 目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記（1）から（3）に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。
- (5) 資産複合... 目論見書または投資信託約款において、上記（1）から（4）に掲げる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う。

#### 4. 独立した区分

- (1) MMF（マネー・マネージメント・ファンド）...

「MRF及びMMFの運営に関する規則」に定めるMMFをいう。

(2) MRF(マネー・リザーブ・ファンド)...

「MRF及びMMFの運営に関する規則」に定めるMRFをいう。

(3) ETF... 投資信託及び投資法人に関する法律施行令(平成12年政令480号)第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法(昭和32年法律第26号)第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

## 5. 補足分類

(1) インデックス型... 目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。

(2) 特殊型... 目論見書または投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。なお、下記の属性区分で特殊型の小分類において「条件付運用型」に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記するものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

## 属性区分表定義

### 1. 投資対象資産による属性区分

#### (1) 株式

一般... 次の大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのものをいう。

大型株... 目論見書または投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。

中小型株... 目論見書または投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

#### (2) 債券

一般... 次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらないすべてのものをいう。

公債... 目論見書または投資信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。

社債... 目論見書または投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。

その他債券... 目論見書または投資信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。

格付等クレジットによる属性...

目論見書または投資信託約款において、上記 から の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記 から に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3) 不動産投信... これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4) その他資産... 組み入れている資産を記載するものとする。

(5) 資産複合... 以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

資産配分固定型... 目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

資産配分変更型... 目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

## 2. 決算頻度による属性区分

- 年1回... 目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
- 年2回... 目論見書または投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。
- 年4回... 目論見書または投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。
- 年6回（隔月）... 目論見書または投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。
- 年12回（毎月）... 目論見書または投資信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいう。
- 日々... 目論見書または投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。
- その他... 上記属性にあてはまらないすべてのものをいう。

## 3. 投資対象地域による属性区分（重複使用可能）

- グローバル... 目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。
- 日本... 目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- 北米... 目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- 欧州... 目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- アジア... 目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- オセアニア... 目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- 中南米... 目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- アフリカ... 目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- 中近東（中東）... 目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- エマージング... 目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

## 4. 投資形態による属性区分

- ファミリーファンド... 目論見書または投資信託約款において、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う。
- ファンド・オブ・ファンズ... 「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

## 5. 為替ヘッジによる属性区分

- 為替ヘッジあり... 目論見書または投資信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。



為替ヘッジなし... 目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

## 6. インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分

日経225

TOPIX

その他の指数...上記指数にあてはまらないすべてのものをいう。

## 7. 特殊型

ブル・ベア型... 目論見書または投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動(一定倍の連動もしくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。

条件付運用型... 目論見書または投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。

ロング・ショート型/絶対収益追求型...

目論見書または投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨もしくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。

その他型... 目論見書または投資信託約款において、上記 から に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

## (2) 【ファンドの沿革】

2017年10月 3日

信託契約締結、設定、運用開始。

## (3) 【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(イ) 委託会社 「三井住友D Sアセットマネジメント株式会社」

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

(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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

(ハ) 販売会社

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

委託会社は販売会社としての役割も有する場合があります。

ロ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

20億円(2024年9月30日現在)

(ロ) 会社の沿革

1985年7月15日 三生投資顧問株式会社設立

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

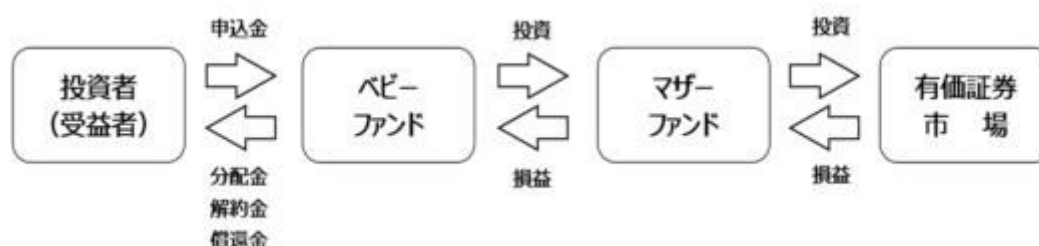
## (八) 大株主の状況

(2024年9月30日現在)

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

## 八 ファンドの運用形態（ファミリーファンド方式による運用）

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



## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

## イ 基本方針

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

## ロ 投資態度

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

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

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

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

- (ハ) 実質組入外貨建資産については、マザーファンド受益証券で対円での為替ヘッジを行っている場合を除き、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

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

## ファンドの特色

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

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

株式 ■ 国内株式 ■ 先進国株式(除く日本) ■ 新興国株式

リート ■ 国内リート ■ 外国リート

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

[各マザーファンドの対象指数と基本資産配分比率]

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

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

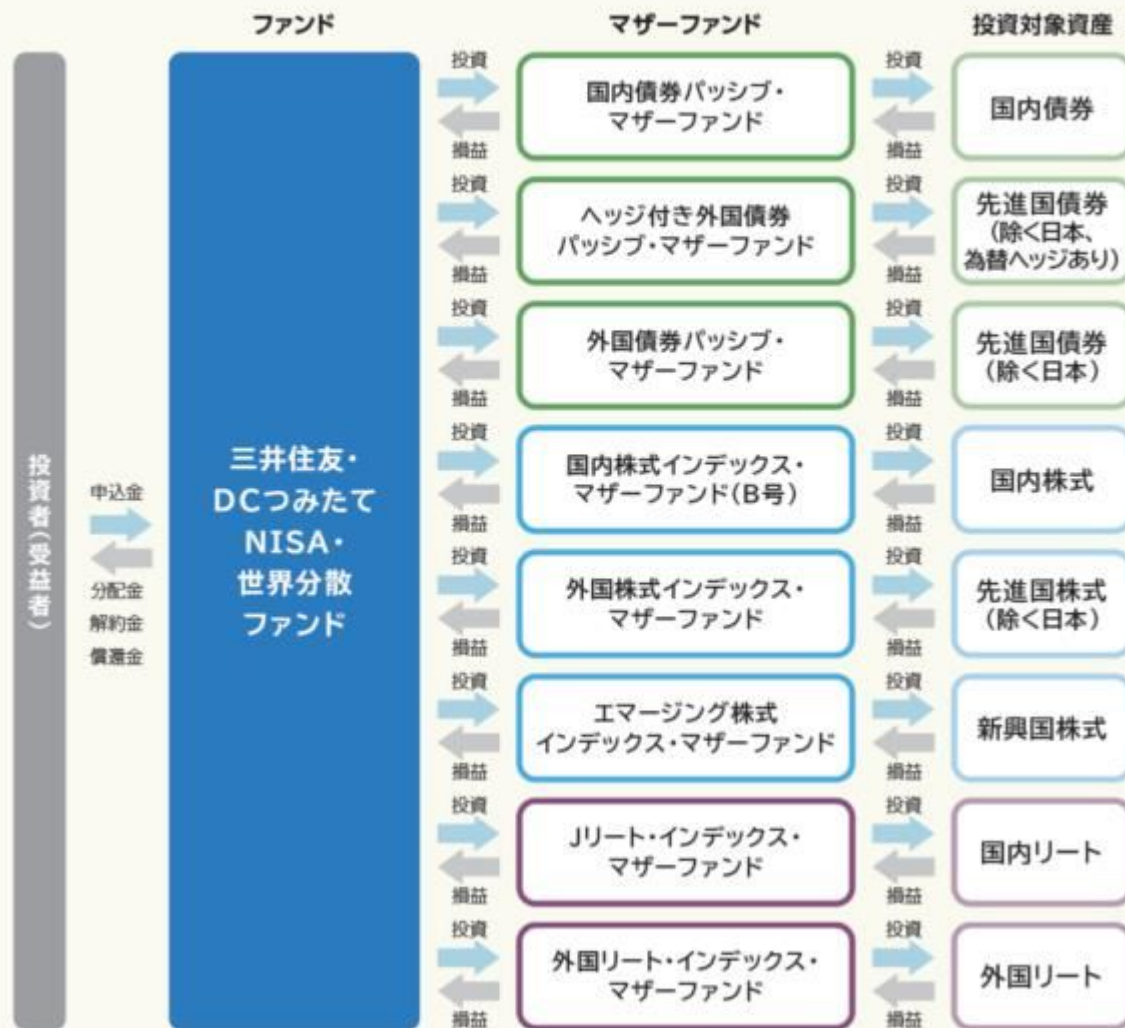
※資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

### 指数の著作権など

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

## ファンドのしくみ

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



## 各マザーファンドの投資方針等

## ▶ 債券

## 国内債券

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

## 先進国債券(除く日本、為替ヘッジあり)…為替ヘッジあり

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

## 先進国債券(除く日本)…為替ヘッジなし

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

## ▶ 株式

## 国内株式

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

## 先進国株式(除く日本)…為替ヘッジなし

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

## 新興国株式…為替ヘッジなし

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

## ▶リート

## 国内リート

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

## 外国リート…為替ヘッジなし

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

## (2) 【投資対象】

## イ 投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

(ロ) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1. 為替手形

## ロ 投資対象とする有価証券

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

1. 株券または新株引受権証書
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. 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。)
20. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

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

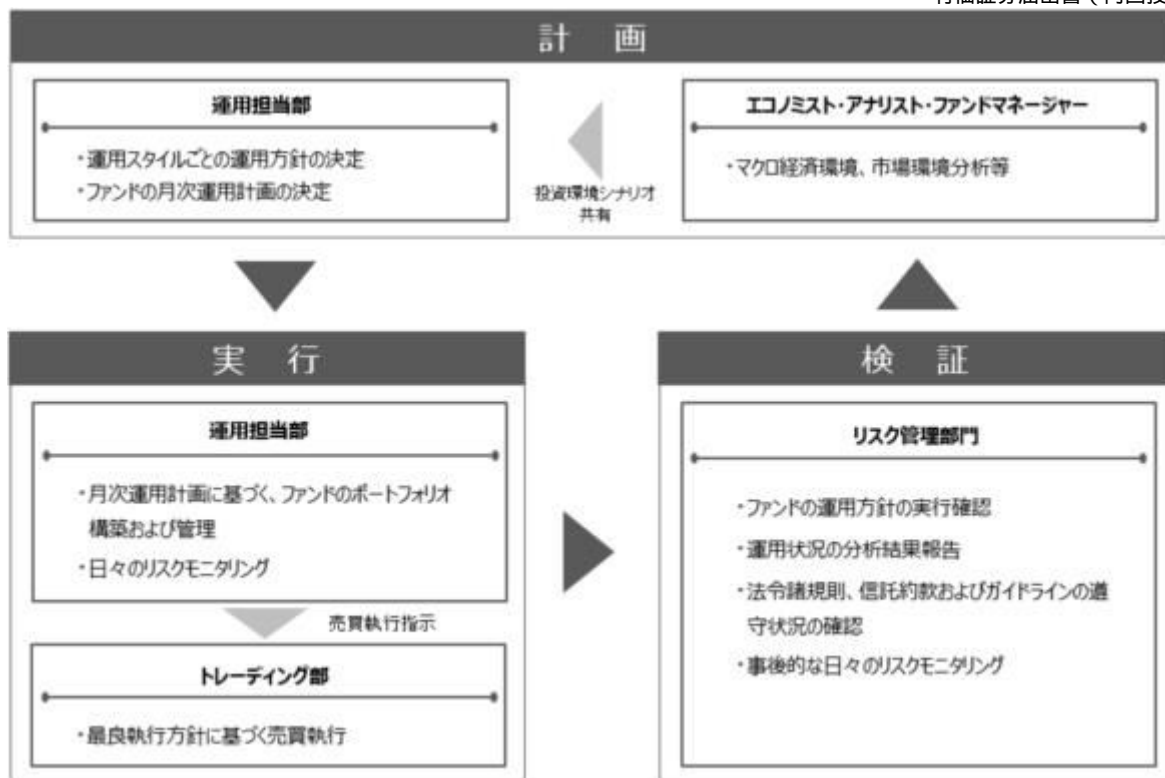
#### 八 投資対象とする金融商品

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

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

### (3) 【運用体制】

#### イ ファンドの運用体制



リスク管理部門の人員数は、約40名です。

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

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

#### （４）【分配方針】

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

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

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

（基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。）

#### （５）【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- イ 株式への実質投資割合には制限を設けません。

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

率を合計したものをいいます（以下同じ。）。

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

ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

#### イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

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

#### ロ 投資する株式等の範囲

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

#### ハ 信用取引の指図

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

#### ニ 先物取引等の指図

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

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

#### ホ スワップ取引の指図

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

#### ヘ 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図

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

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

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

#### ト 有価証券の貸付けの指図

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

#### チ 有価証券の空売りの指図

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

#### リ 有価証券の借入れの指図

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

ない範囲で行うものとします。

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

(二) 借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

ヌ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ル 外国為替予約取引の指図

(イ) 委託会社は、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

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

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

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

ヲ 資金の借入れ

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

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

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

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

(二) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

法令に基づく投資制限

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

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

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

号)

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

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

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

（参考情報：マザーファンドの投資方針等）

（国内債券パッシブ・マザーファンド）

（1）投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

（ロ）公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

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

（2）投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

1．株券または新株引受権証書

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10．コマースナル・ペーパー

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

## よび新株予約権証券

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

## 八 投資対象とする金融商品

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

## (3) 投資制限

## イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

## (ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド)

## (1) 投資方針等

## イ 基本方針

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

## ロ 投資態度

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



最小化します。

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

## (2) 投資対象

### イ 投資対象とする資産の種類

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

### ロ 投資対象とする有価証券

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

### ハ 投資対象とする金融商品

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

ファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

### （３）投資制限

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

### （外国債券パッシブ・マザーファンド）

#### （１）投資方針等

##### イ 基本方針

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

##### ロ 投資態度

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

#### （２）投資対象

##### イ 投資対象とする資産の種類

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

##### ロ 投資対象とする有価証券

- １．株券または新株引受権証券
- ２．国債証券

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

### （3）投資制限

#### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

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

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

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

## (国内株式インデックス・マザーファンド(B号))

### (1) 投資方針等

#### イ 基本方針

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

#### ロ 投資態度

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

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

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

### (2) 投資対象

#### イ 投資対象とする資産の種類

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

#### ロ 投資対象とする有価証券

1. 株券または新株引受権証書

2. 国債証券

3. 特別の法律により法人の発行する債券

4. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

#### ハ 投資対象とする金融商品

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

### (3) 投資制限

#### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 外貨建資産への投資は行いません。

(ロ) 株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

## (外国株式インデックス・マザーファンド)

### (1) 投資方針等

#### イ 基本方針

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

#### ロ 投資態度

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

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

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

### (2) 投資対象

#### イ 投資対象とする資産の種類

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

#### ロ 投資対象とする有価証券

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

#### ハ 投資対象とする金融商品

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

ファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

### (3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 株式への投資割合には制限を設けません。

(ロ) 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

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

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

### (エマーシング株式インデックス・マザーファンド)

#### (1) 投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

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

(ハ) 外貨建資産について円に対する為替ヘッジは原則として行いません。

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

#### (2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

をいいます。）

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

#### 八 投資対象とする金融商品

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

#### （3）投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）株式への投資割合には制限を設けません。

（ロ）外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

（ハ）投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

（ニ）同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

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

（Jリート・インデックス・マザーファンド）

（1）投資方針等

## イ 基本方針

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

## ロ 投資態度

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

## （2）投資対象

### イ 投資対象とする資産の種類

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

### ロ 投資対象とする有価証券

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

### ハ 投資対象とする金融商品

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

## （3）投資制限

### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

（外国リート・インデックス・マザーファンド）



### （１）投資方針等

#### イ 基本方針

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

#### ロ 投資態度

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

### （２）投資対象

#### イ 投資対象とする資産の種類

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

#### ロ 投資対象とする有価証券

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

#### ハ 投資対象とする金融商品

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

### （３）投資制限

#### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

## 3【投資リスク】

## イ ファンドのもつリスクの特性

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

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

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

当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

### （イ）株式市場リスク

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

### （ロ）債券市場リスク

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

### （ハ）不動産投資信託（リート）に関するリスク

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

### （ニ）信用リスク

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

### （ホ）為替変動リスク

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

### （ヘ）カントリーリスク

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

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

### （ト）流動性リスク

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

基準価額が下落する要因となります。

## □ その他の留意点

### （イ）ファンド固有の留意点

合成指数の動きと連動しない要因

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

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

### （ロ）投資信託に関する留意点

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

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

### （ハ）分配金に関する留意事項

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



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

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

## 八 投資リスクの管理体制

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

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

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

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

当該流動性リスクの適切な管理の実施等について、定期的にリスク管理会議へ報告します。

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

## （参考情報）投資リスクの定量的比較

### 「ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移」

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



### 「ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較」

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



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## 各資産クラスの指数

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

※上記各指数に関する知的所有権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。また、上記各指数の発行者および許諾者は、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

(3) 【信託報酬等】

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

信託報酬の配分は以下の通りです。

< 信託報酬の配分（税抜き） >

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

上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。

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

(4) 【その他の手数料等】

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

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

上記(1)～(4)にかかる手数料等の合計額、その上限額、計算方法等は、手数料等に保有期間に応じて異なるものが含まれていたり、発生時・請求時に初めて具体的な金額を認識するものがあつたりすることから、あらかじめ具体的に記載することはできません。

(5) 【課税上の取扱い】

イ 個別元本について

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

ります。

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

#### ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

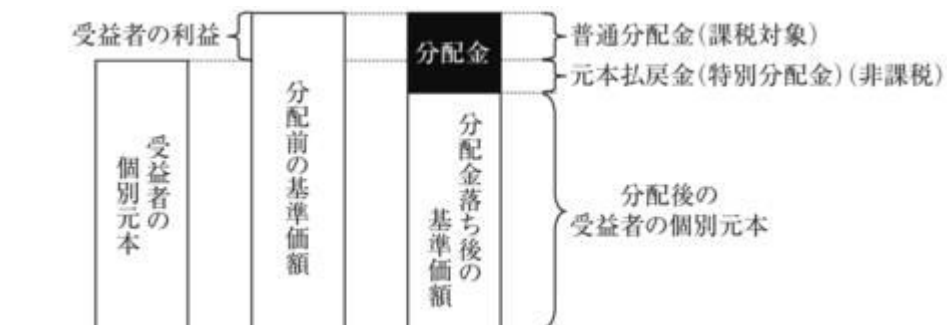
#### ハ 収益分配金の課税について

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

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



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



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

## 二 個人、法人別の課税の取扱いについて

### (イ) 個人の受益者に対する課税

#### ・収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315%（所得税15.315%および

地方税5%)の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。確定申告による総合課税または申告分離課税の選択も可能です。

・一部解約時および償還時

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

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

(ロ)法人の受益者に対する課税

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

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

なお、当ファンドは、配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

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

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

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

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

当ファンドは、NISAの「成長投資枠(特定非課税管理勘定)」および「つみたて投資枠(特定累積投資勘定)」の対象ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」をご利用の場合

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

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

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2024年9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9月12日～2024年9月10日)における当ファンドの総経費率(年率換算)は以下の通りです。

総経費率(①+②)	①運用管理費用の比率	②その他費用の比率
0.27%	0.23%	0.04%

※上記は、対象期間の運用報告書に記載されている総経費率(原則として、購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税は含まれていません。)です。  
 ※当ファンドが上場投資信託(ETF)および上場不動産投資信託(REIT)に投資している場合、当該ETFおよびREITの管理費用等は含まれていません。  
 ※計算方法等の詳細は、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。なお、新たな対象期間にかかる運用報告書が作成され、上記の総経費率が更新されている場合があります。  
 運用報告書は、委託会社のホームページ(<https://www.smd-am.co.jp/fund/unpo/>)から検索いただけます。

**5【運用状況】****(1)【投資状況】**

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

2024年9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	3,219,043,030	99.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	29,361,907	0.90
合計(純資産総額)		3,248,404,937	100.00

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

**(2)【投資資産】****【投資有価証券の主要銘柄】**

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

**イ 主要投資銘柄**

2024年9月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	外国株式イン デックス・マ ザーファンド	70,941,793	8.7450	620,385,418	9.1343	648,003,619	19.95
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	283,205,387	2.2495	637,074,276	2.2578	639,421,122	19.68
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	399,506,141	1.1969	478,152,375	1.1996	479,247,566	14.75
日本	親投資 信託受 益証券	外国リート・イン デックス・マ ザーファンド	131,745,715	3.5572	468,645,858	3.6203	476,959,012	14.68



日本	親投資 信託受 益証券	エマージング株 式インデック ス・マザーファ ンド	154,765,452	1.9792	306,312,418	2.1820	337,698,216	10.40
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）	67,486,931	4.5995	310,404,106	4.7669	321,703,451	9.90
日本	親投資 信託受 益証券	ヘッジ付き外国 債券パッシブ・ マザーファンド	127,986,090	1.2395	158,638,758	1.2376	158,395,584	4.88
日本	親投資 信託受 益証券	リリート・イン デックス・マ ザーファンド	61,188,113	2.6181	160,196,598	2.5759	157,614,460	4.85

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

#### □ 種類別投資比率

2024年9月30日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	99.10
合計	99.10

#### 【投資不動産物件】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

該当事項はありません。

#### (3) 【運用実績】

##### 【純資産の推移】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

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

第7期 (2024年 9月10日)	3,111,955,190	3,111,955,190	15,445	15,445
2023年 9月末日	2,222,981,199	-	13,856	-
10月末日	2,205,503,198	-	13,518	-
11月末日	2,354,113,724	-	14,231	-
12月末日	2,428,774,076	-	14,469	-
2024年 1月末日	2,529,865,391	-	14,753	-
2月末日	2,640,244,817	-	15,094	-
3月末日	2,753,988,706	-	15,494	-
4月末日	2,815,693,647	-	15,579	-
5月末日	2,904,475,773	-	15,669	-
6月末日	3,073,147,238	-	16,191	-
7月末日	3,086,624,429	-	15,834	-
8月末日	3,127,977,998	-	15,662	-
9月末日	3,248,404,937	-	15,832	-

## 【分配の推移】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2017年10月 3日～2018年 9月10日	0
第2期	2018年 9月11日～2019年 9月10日	0
第3期	2019年 9月11日～2020年 9月10日	0
第4期	2020年 9月11日～2021年 9月10日	0
第5期	2021年 9月11日～2022年 9月12日	0
第6期	2022年 9月13日～2023年 9月11日	0
第7期	2023年 9月12日～2024年 9月10日	0

## 【収益率の推移】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

	収益率(%)
第1期	0.5
第2期	3.9
第3期	2.7
第4期	20.0
第5期	4.6
第6期	4.4
第7期	9.9

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

## (4) 【設定及び解約の実績】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	134,068,987	19,587,428
第2期	198,345,231	29,755,343
第3期	284,669,114	59,535,952
第4期	357,578,274	77,546,767
第5期	503,710,231	77,728,393
第6期	492,057,391	128,687,266
第7期	620,093,815	182,769,067

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

(参考)

(1) 投資状況

国内債券パッシブ・マザーファンド

2024年9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	106,859,210,390	78.10
地方債証券	日本	11,563,255,900	8.45
特殊債券	日本	10,123,577,021	7.40
社債券	日本	7,830,159,100	5.72
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	440,487,612	0.33
合計(純資産総額)		136,816,690,023	100.00

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2024年9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	16,882,375,872	45.17
	中国	4,004,814,136	10.72
	フランス	2,800,080,919	7.49
	イタリア	2,553,103,044	6.83
	ドイツ	2,215,137,829	5.93
	イギリス	2,005,007,802	5.36
	スペイン	1,670,511,366	4.47
	カナダ	713,916,386	1.91
	ベルギー	592,327,712	1.58
	オランダ	494,534,258	1.32
	オーストラリア	490,328,357	1.31
	オーストリア	426,294,153	1.14
	シンガポール	340,839,968	0.91
	メキシコ	264,945,164	0.71
	ポーランド	190,957,013	0.51
	フィンランド	185,961,176	0.50
アイルランド	173,339,247	0.46	
イスラエル	109,862,753	0.29	

	ニュージーランド	102,180,289	0.27
	デンマーク	100,047,087	0.27
	ノルウェー	57,015,727	0.15
	スウェーデン	55,196,154	0.15
	小計	36,428,776,412	97.48
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	943,314,125	2.52
合計（純資産総額）		37,372,090,537	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建	-	60,324,341	0.16
為替予約取引	売建	-	36,410,933,827	97.43

### 外国債券パッシブ・マザーファンド

2024年9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	82,914,705,419	45.56
	中国	19,650,489,053	10.80
	フランス	13,690,053,250	7.52
	イタリア	12,514,963,801	6.88
	ドイツ	10,874,696,943	5.98
	イギリス	9,797,447,781	5.38
	スペイン	8,126,937,235	4.47
	カナダ	3,454,723,406	1.90
	ベルギー	2,884,237,097	1.58
	オランダ	2,447,599,811	1.34
	オーストラリア	2,399,661,528	1.32
	オーストリア	2,076,080,161	1.14
	メキシコ	1,334,805,271	0.73
	マレーシア	977,561,259	0.54
	ポーランド	972,965,907	0.53
	フィンランド	940,792,284	0.52
	アイルランド	890,272,265	0.49
	シンガポール	754,115,194	0.41
	イスラエル	541,915,970	0.30
	ニュージーランド	503,894,420	0.28
デンマーク	484,075,334	0.27	
スウェーデン	290,056,838	0.16	
ノルウェー	283,802,284	0.16	
小計	178,805,852,511	98.26	
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	3,175,566,238	1.74
合計（純資産総額）		181,981,418,749	100.00

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

2024年9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	330,222,231,790	98.10
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	6,399,065,345	1.90
合計（純資産総額）		336,621,297,135	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	6,751,125,000	2.01
合計	買建	-	6,751,125,000	2.01

## 外国株式インデックス・マザーファンド

2024年9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	574,646,178,220	70.29
	イギリス	30,074,991,615	3.68
	カナダ	26,603,480,190	3.25
	スイス	24,123,837,879	2.95
	フランス	22,772,730,348	2.79
	ドイツ	19,281,269,558	2.36
	アイルランド	14,863,601,322	1.82
	オーストラリア	14,464,614,522	1.77
	オランダ	14,424,841,812	1.76
	デンマーク	7,237,063,213	0.89
	スウェーデン	7,234,878,162	0.89
	スペイン	5,871,515,702	0.72
	イタリア	4,655,647,420	0.57
	香港	3,249,827,334	0.40
	シンガポール	2,383,233,064	0.29
	フィンランド	2,204,089,920	0.27
	ジャージー	1,885,689,618	0.23
	ベルギー	1,705,566,512	0.21
	イスラエル	1,634,889,732	0.20
	ノルウェー	1,211,490,599	0.15
	ケイマン諸島	1,185,924,146	0.15
	バミューダ	1,013,778,137	0.12
	オランダ領キュラソー	733,380,281	0.09
	ニュージーランド	563,367,654	0.07
	リベリア	549,098,618	0.07
	ルクセンブルグ	430,431,937	0.05
オーストリア	404,488,351	0.05	

	ポルトガル	345,844,919	0.04
	パナマ	224,438,657	0.03
	マン島	63,509,447	0.01
	小計	786,043,698,889	96.15
新株予約権証券	カナダ	-	0.00
投資証券	アメリカ	13,889,448,196	1.70
	オーストラリア	1,512,799,528	0.19
	フランス	313,089,319	0.04
	イギリス	269,690,142	0.03
	シンガポール	201,390,106	0.02
	香港	174,592,613	0.02
	ケイマン諸島	80,758,561	0.01
	ベルギー	54,476,867	0.01
	カナダ	46,644,373	0.01
	小計	16,542,889,705	2.02
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	14,908,407,506	1.83
合計（純資産総額）		817,494,996,100	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	688,028,930	0.08
株価指数先物取引	買建	ドイツ	2,380,961,100	0.29
株価指数先物取引	買建	アメリカ	13,679,983,611	1.67
株価指数先物取引	買建	オーストラリア	448,258,882	0.05
合計	買建	-	17,197,232,523	2.10

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率 （％）
為替予約取引	買建	-	3,891,016,247	0.48

## エマージング株式インデックス・マザーファンド

2024年9月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
株式	インド	9,524,707,306	18.25
	台湾	8,589,140,295	16.46
	ケイマン諸島	7,873,113,636	15.09
	韓国	5,178,652,958	9.92
	中国	2,989,639,656	5.73
	ブラジル	1,953,559,530	3.74
	南アフリカ	1,414,468,237	2.71
	インドネシア	817,693,654	1.57
	マレーシア	730,433,191	1.40
	タイ	719,609,798	1.38
	メキシコ	674,202,938	1.29
	ポーランド	390,366,853	0.75
	香港	370,695,864	0.71

	トルコ	311,213,232	0.60
	フィリピン	279,812,803	0.54
	ギリシャ	225,133,105	0.43
	チリ	198,248,124	0.38
	バミューダ	182,041,313	0.35
	アメリカ	161,708,124	0.31
	ハンガリー	112,465,208	0.22
	イギリス	66,889,819	0.13
	チェコ	59,653,561	0.11
	ルクセンブルグ	51,311,867	0.10
	コロンビア	44,868,185	0.09
	エジプト	33,445,131	0.06
	オランダ	28,250,531	0.05
	ペルー	13,179,208	0.03
	シンガポール	12,241,951	0.02
	小計	43,006,746,078	82.42
投資信託受益証券	香港	1,927,046,716	3.69
投資証券	アメリカ	3,115,635,130	5.97
	メキシコ	230,692,586	0.44
	ブラジル	76,238,043	0.15
	小計	3,422,565,759	6.56
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	3,823,446,402	7.33
合計(純資産総額)		52,179,804,955	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	3,958,273,998	7.59
合計	買建	-	3,958,273,998	7.59

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	-	124,524,700	0.24

Jリート・インデックス・マザーファンド

2024年9月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	日本	15,409,516,500	98.48
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	237,073,255	1.52
合計(純資産総額)		15,646,589,755	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
リート指数先物取引	買建	日本	34,350,000	0.22
合計	買建	-	34,350,000	0.22

## 外国リート・インデックス・マザーファンド

2024年9月30日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	32,403,062,787	76.82
	オーストラリア	3,090,948,746	7.33
	イギリス	1,993,321,326	4.73
	シンガポール	1,328,778,195	3.15
	フランス	784,641,358	1.86
	カナダ	592,149,666	1.40
	ベルギー	411,005,135	0.97
	香港	401,344,637	0.95
	スペイン	210,965,635	0.50
	ガーンジィ	84,473,384	0.20
	韓国	76,610,006	0.18
	オランダ	57,924,050	0.14
	イスラエル	38,295,358	0.09
	ニュージーランド	36,272,661	0.09
	アイルランド	14,079,064	0.03
	ドイツ	13,591,275	0.03
	イタリア	3,226,110	0.01
小計		41,540,689,393	98.48
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	641,101,790	1.52
合計（純資産総額）		42,181,791,183	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率 (%)
為替予約取引	買建	-	127,897,859	0.30

## (2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

国内債券パッシブ・マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2024年9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	150 5年国債	2,590,000,000	99.03	2,564,877,000	99.19	2,568,891,500	0.005	2026/12/20	1.88
日本	国債 証券	461 2年国債	2,000,000,000	100.16	2,003,216,000	100.08	2,001,640,000	0.400	2026/06/01	1.46
日本	国債 証券	375 10年国 債	1,710,000,000	101.74	1,739,792,500	102.24	1,748,372,400	1.100	2034/06/20	1.28
日本	国債 証券	154 5年国債	1,220,000,000	98.91	1,206,641,000	99.16	1,209,788,600	0.100	2027/09/20	0.88



日本	国債証券	369 10年国債	1,220,000,000	96.98	1,183,156,000	98.56	1,202,432,000	0.500	2032/12/20	0.88
日本	国債証券	148 5年国債	1,180,000,000	99.27	1,171,421,400	99.40	1,172,943,600	0.005	2026/06/20	0.86
日本	国債証券	156 5年国債	1,180,000,000	99.10	1,169,380,000	99.38	1,172,684,000	0.200	2027/12/20	0.86
日本	国債証券	370 10年国債	1,190,000,000	96.62	1,149,778,000	98.28	1,169,567,700	0.500	2033/03/20	0.85
日本	国債証券	362 10年国債	1,180,000,000	96.05	1,133,374,100	97.19	1,146,842,000	0.100	2031/03/20	0.84
日本	国債証券	366 10年国債	1,180,000,000	95.42	1,125,930,800	97.00	1,144,635,400	0.200	2032/03/20	0.84
日本	国債証券	368 10年国債	1,180,000,000	95.12	1,122,404,200	96.44	1,138,039,200	0.200	2032/09/20	0.83
日本	国債証券	361 10年国債	1,160,000,000	96.34	1,117,544,000	97.38	1,129,619,600	0.100	2030/12/20	0.83
日本	国債証券	363 10年国債	1,160,000,000	95.76	1,110,819,200	96.99	1,125,084,000	0.100	2031/06/20	0.82
日本	国債証券	365 10年国債	1,160,000,000	94.96	1,101,581,600	96.51	1,119,469,600	0.100	2031/12/20	0.82
日本	国債証券	371 10年国債	1,150,000,000	95.52	1,098,480,000	97.18	1,117,512,500	0.400	2033/06/20	0.82
日本	国債証券	367 10年国債	1,150,000,000	95.09	1,093,535,000	96.73	1,112,372,000	0.200	2032/06/20	0.81
日本	国債証券	359 10年国債	1,130,000,000	96.82	1,094,066,000	97.72	1,104,258,600	0.100	2030/06/20	0.81
日本	国債証券	364 10年国債	1,120,000,000	95.48	1,069,343,200	96.75	1,083,622,400	0.100	2031/09/20	0.79
日本	国債証券	149 5年国債	1,090,000,000	99.16	1,080,844,000	99.28	1,082,108,400	0.005	2026/09/20	0.79
日本	国債証券	372 10年国債	1,050,000,000	98.61	1,035,356,500	100.34	1,053,517,500	0.800	2033/09/20	0.77
日本	国債証券	357 10年国債	1,050,000,000	97.31	1,021,755,000	97.97	1,028,632,500	0.100	2029/12/20	0.75
日本	国債証券	373 10年国債	1,020,000,000	96.50	984,300,000	98.28	1,002,476,400	0.600	2033/12/20	0.73
日本	国債証券	374 10年国債	1,000,000,000	97.71	977,141,600	99.78	997,800,000	0.800	2034/03/20	0.73

日本	国債証券	358 10年国債	930,000,000	97.06	902,675,400	97.85	909,958,500	0.100	2030/03/20	0.67
日本	国債証券	147 20年国債	840,000,000	105.61	887,090,400	107.14	900,009,600	1.600	2033/12/20	0.66
日本	国債証券	158 5年国債	880,000,000	98.59	867,595,000	98.96	870,821,600	0.100	2028/03/20	0.64
日本	国債証券	170 20年国債	975,000,000	84.28	821,733,700	85.54	834,005,250	0.300	2039/09/20	0.61
日本	国債証券	172 5年国債	830,000,000	100.02	830,166,000	100.02	830,190,900	0.500	2029/06/20	0.61
日本	国債証券	360 10年国債	850,000,000	96.57	820,863,000	97.57	829,328,000	0.100	2030/09/20	0.61
日本	国債証券	344 10年国債	811,000,000	99.38	805,971,800	99.46	806,636,820	0.100	2026/09/20	0.59

## □ 種類別投資比率

2024年9月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	78.10
地方債証券	8.45
特殊債券	7.40
社債券	5.72
合計	99.68

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

### イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2024年9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	2,010,000	13,495.41	271,257,679	13,615.30	273,667,533	0.750	2026/05/31	0.73
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	10,500,000	2,132.08	223,868,405	2,130.73	223,726,708	2.670	2033/05/25	0.60
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	10,800,000	2,058.90	222,361,550	2,062.23	222,721,211	1.990	2026/03/15	0.60
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	10,400,000	2,059.98	214,238,365	2,068.80	215,154,877	2.040	2027/02/25	0.58
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	10,200,000	2,095.74	213,765,663	2,103.37	214,544,005	2.480	2028/09/25	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,300,000	15,548.58	202,131,514	15,548.58	202,131,514	4.625	2054/05/15	0.54

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,300,000	14,490.38	188,374,911	14,566.17	189,360,176	4.000	2034/02/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,290,000	14,606.27	188,420,941	14,607.42	188,435,671	4.250	2054/02/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,200,000	15,044.31	180,531,755	15,126.24	181,514,879	4.625	2031/04/30	0.49
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	8,700,000	2,041.92	177,646,635	2,046.51	178,046,350	1.620	2027/08/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,200,000	14,531.06	174,372,670	14,613.84	175,366,070	4.500	2027/04/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,170,000	14,847.94	173,720,953	14,886.45	174,171,506	4.500	2029/05/31	0.47
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	8,200,000	2,090.43	171,415,236	2,097.30	171,978,589	2.370	2029/01/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,190,000	14,333.66	170,570,556	14,418.16	171,576,061	4.000	2027/01/15	0.46
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	8,300,000	2,053.50	170,440,716	2,059.70	170,954,936	1.850	2027/05/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,180,000	14,396.33	169,876,715	14,439.14	170,381,825	3.875	2033/08/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,140,000	13,907.75	158,548,394	14,009.23	159,705,278	2.750	2027/04/30	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,060,000	14,926.42	158,220,094	14,998.78	158,987,089	4.375	2034/05/15	0.43
フランス	国債証券	FRANCE OAT.	1,130,000	13,560.96	153,238,806	13,642.74	154,163,006	0.000	2030/11/25	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	980,000	15,366.31	150,589,855	15,463.23	151,539,609	4.750	2043/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,010,000	14,620.15	147,663,545	14,730.88	148,781,866	4.125	2032/11/15	0.40
フランス	国債証券	FRANCE OAT.	920,000	16,032.95	147,503,153	16,127.46	148,372,636	2.750	2029/02/25	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	14,469.97	144,699,674	14,538.91	145,389,059	4.875	2026/04/30	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	960,000	15,045.17	144,433,625	15,122.67	145,177,648	4.500	2033/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	14,371.34	143,713,409	14,444.42	144,444,187	4.500	2026/03/31	0.39
フランス	国債証券	FRANCE OAT.	950,000	14,997.42	142,475,496	15,113.17	143,575,085	0.750	2028/02/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,020,000	13,992.54	142,723,862	14,071.89	143,533,312	3.500	2033/02/15	0.38
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	6,800,000	2,084.09	141,718,199	2,091.10	142,195,103	2.480	2027/04/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	980,000	14,175.66	138,921,449	14,276.28	139,907,571	3.500	2028/01/31	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	13,699.23	136,992,254	13,802.70	138,027,046	2.750	2029/05/31	0.37

## □ 種類別投資比率

2024年9月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	97.48
合計	97.48

## 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9月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,450,000	13,418.76	1,536,448,128	13,822.40	1,582,664,959	1.625	2026/05/15	0.87
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	76,000,000	2,061.60	1,566,817,157	2,068.80	1,572,285,640	2.040	2027/02/25	0.86
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	72,000,000	2,056.34	1,480,561,276	2,081.49	1,498,675,982	2.390	2026/11/15	0.82
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,200,000	13,643.42	1,118,760,273	13,979.12	1,146,287,752	2.250	2026/03/31	0.63
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	50,000,000	2,059.39	1,029,695,660	2,089.22	1,044,611,674	2.690	2026/08/12	0.57
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	38,700,000	2,333.75	903,160,408	2,611.29	1,010,570,795	3.720	2051/04/12	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	14,221.21	824,830,247	14,355.50	832,618,880	4.250	2025/12/31	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	14,348.60	789,173,153	14,998.78	824,933,012	4.375	2034/05/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,600,000	14,475.25	810,613,910	14,730.88	824,929,159	4.125	2032/11/15	0.45
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	38,000,000	2,037.76	774,348,230	2,095.05	796,119,271	2.400	2028/07/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	14,107.00	775,884,807	14,466.40	795,651,953	4.125	2027/02/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	13,194.67	752,096,466	13,537.51	771,638,201	2.875	2032/05/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,900,000	12,529.84	739,260,472	13,047.52	769,803,692	0.750	2028/01/31	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	13,664.11	751,526,260	13,925.60	765,907,734	3.375	2033/05/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	14,127.99	748,783,274	14,298.55	757,823,079	3.875	2026/01/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	13,936.82	710,777,844	14,566.17	742,874,538	4.000	2034/02/15	0.41

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	13,593.61	720,461,075	13,932.30	738,412,084	2.750	2028/02/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,600,000	12,497.72	699,872,558	13,025.68	729,438,221	0.625	2027/12/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	14,910.05	715,682,380	15,122.67	725,888,241	4.500	2033/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	14,276.85	713,842,685	14,503.79	725,189,720	4.000	2028/02/29	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	14,216.99	710,849,637	14,439.14	721,956,886	3.875	2033/08/15	0.40
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	35,000,000	2,052.39	718,336,605	2,062.23	721,781,704	1.990	2026/03/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,900,000	14,244.50	697,980,275	14,418.16	706,489,664	4.000	2027/01/15	0.39
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	32,400,000	2,103.76	681,618,594	2,176.27	705,110,119	3.020	2031/05/27	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	11,863.00	676,191,225	12,317.03	702,070,600	1.125	2031/02/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	14,402.90	691,339,017	14,585.15	700,087,224	4.625	2026/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	12,199.42	670,968,020	12,624.90	694,369,317	1.625	2031/05/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	13,203.81	660,190,478	13,599.74	679,987,129	2.375	2029/03/31	0.37
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	32,000,000	2,045.49	654,555,977	2,117.71	677,665,881	2.600	2030/09/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	12,237.96	648,611,649	12,647.73	670,329,874	1.875	2032/02/15	0.37

## □ 種類別投資比率

2024年9月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	98.26
合計	98.26

## 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9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	4,715,300	2,807.51	13,238,231,495	2,542.50	11,988,650,250	3.56
日本	株式	ソニーグループ	電気機 器	3,105,000	2,572.52	7,987,664,834	2,777.50	8,624,137,500	2.56
日本	株式	日立製作所	電気機 器	2,152,600	2,125.99	4,576,399,368	3,781.00	8,138,980,600	2.42

日本	株式	三菱UFJ フィナンシャル・グループ	銀行業	5,316,700	1,270.59	6,755,323,444	1,453.50	7,727,823,450	2.30
日本	株式	キーエンス	電気機器	88,800	63,722.05	5,658,518,262	68,360.00	6,070,368,000	1.80
日本	株式	リクルート ホールディングス	サービス業	656,400	5,647.63	3,707,104,346	8,705.00	5,713,962,000	1.70
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,821,000	2,449.86	4,461,199,058	3,045.00	5,544,945,000	1.65
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,802,200	2,334.92	4,207,998,244	2,952.50	5,320,995,500	1.58
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	631,000	5,834.47	3,681,551,181	7,678.00	4,844,818,000	1.44
日本	株式	信越化学工業	化学	797,000	5,271.01	4,200,994,507	5,977.00	4,763,669,000	1.42
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	187,600	24,435.81	4,584,158,327	25,290.00	4,744,404,000	1.41
日本	株式	三井物産	卸売業	1,405,900	2,732.95	3,842,255,929	3,178.00	4,467,950,200	1.33
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	853,200	3,731.52	3,183,732,709	5,231.00	4,463,089,200	1.33
日本	株式	任天堂	その他製品	560,200	6,986.21	3,913,677,475	7,636.00	4,277,687,200	1.27
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	26,466,700	172.29	4,560,007,243	146.80	3,885,311,560	1.15
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	438,300	6,183.88	2,710,395,336	8,427.00	3,693,554,100	1.10
日本	株式	第一三共	医薬品	775,300	4,077.86	3,161,562,755	4,709.00	3,650,887,700	1.08
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,178,900	2,539.09	2,993,338,786	2,936.00	3,461,250,400	1.03
日本	株式	HOYA	精密機器	174,700	16,832.38	2,940,617,444	19,785.00	3,456,439,500	1.03
日本	株式	三菱重工業	機械	1,571,200	877.45	1,378,641,816	2,117.50	3,327,016,000	0.99
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	787,500	4,168.55	3,282,734,806	4,103.00	3,231,112,500	0.96
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	2,100,900	1,517.27	3,187,632,574	1,507.50	3,167,106,750	0.94
日本	株式	KDDI	情報・通信業	653,900	4,622.36	3,022,560,141	4,594.00	3,004,016,600	0.89
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	14,232,000	180.79	2,573,032,148	187.20	2,664,230,400	0.79
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	52,800	38,645.36	2,040,475,101	47,420.00	2,503,776,000	0.74
日本	株式	富士通	電気機器	822,300	2,135.96	1,756,397,524	2,935.50	2,413,861,650	0.72
日本	株式	三菱電機	電気機器	979,400	2,031.72	1,989,863,324	2,303.50	2,256,047,900	0.67
日本	株式	村田製作所	電気機器	792,400	2,888.20	2,288,610,462	2,806.50	2,223,870,600	0.66
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	531,000	3,824.38	2,030,747,026	4,179.00	2,219,049,000	0.66
日本	株式	ダイキン工業	機械	107,000	22,063.93	2,360,840,432	20,075.00	2,148,025,000	0.64

□ 種別・業種別投資比率

2024年9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	0.26
	建設業	2.18
	食料品	3.21
	繊維製品	0.39
	パルプ・紙	0.15
	化学	5.72
	医薬品	4.56
	石油・石炭製品	0.55
	ゴム製品	0.59
	ガラス・土石製品	0.67
	鉄鋼	0.85
	非鉄金属	0.79
	金属製品	0.51
	機械	5.43
	電気機器	17.34
	輸送用機器	7.08
	精密機器	2.38
	その他製品	2.46
	電気・ガス業	1.35
	陸運業	2.34
	海運業	0.79
	空運業	0.38
	倉庫・運輸関連業	0.15
	情報・通信業	7.41
	卸売業	7.23
	小売業	4.43
	銀行業	7.27
	証券、商品先物取引業	0.80
	保険業	2.98
その他金融業	1.19	
不動産業	1.91	
サービス業	4.66	
合計		98.10

## 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9月30日現在

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

アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,243,373	27,118.54	33,718,463,618	32,512.47	40,425,123,258	4.94
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	602,701	54,735.07	32,988,879,290	61,091.29	36,819,784,346	4.50
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	2,099,584	7,603.32	15,963,808,148	17,327.42	36,380,377,992	4.45
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	799,908	21,449.55	17,157,668,261	26,828.96	21,460,698,215	2.63
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	187,256	49,743.50	9,314,769,454	80,979.29	15,163,858,452	1.85
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	501,072	19,644.20	9,843,156,472	23,400.58	11,725,377,175	1.43
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	431,512	19,805.97	8,546,511,576	23,591.84	10,180,162,795	1.25
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	378,262	14,197.03	5,370,198,765	24,648.04	9,323,418,306	1.14
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	245,643	34,063.29	8,367,409,226	37,175.46	9,131,890,489	1.12
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	68,957	88,209.79	6,082,682,739	125,286.97	8,639,413,362	1.06
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	113,330	52,371.36	5,935,246,342	65,294.69	7,399,847,569	0.91
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	245,020	22,674.97	5,555,820,509	30,044.67	7,361,543,818	0.90



アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	78,512	76,041.86	5,970,198,667	83,047.45	6,520,221,433	0.80
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	384,075	14,683.12	5,639,418,226	16,530.99	6,349,139,446	0.78
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	134,891	36,548.99	4,930,129,363	39,275.01	5,297,845,926	0.65
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	71,169	59,197.96	4,213,059,544	70,457.24	5,014,371,114	0.61
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	202,313	21,769.50	4,404,252,135	24,770.79	5,011,453,140	0.61
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	85,029	45,076.23	3,832,786,896	57,024.92	4,848,771,659	0.59
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	38,003	87,457.98	3,323,665,739	126,404.54	4,803,751,832	0.59
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	205,298	21,772.94	4,469,940,803	23,036.62	4,729,372,423	0.58
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	275,286	15,167.97	4,175,529,007	17,029.17	4,687,892,092	0.57
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	379,538	7,622.75	2,893,124,875	11,387.00	4,321,798,978	0.53

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	150,635	20,368.42	3,068,197,247	27,802.38	4,188,011,014	0.51
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	34,249	104,395.90	3,575,455,114	120,736.34	4,135,098,874	0.51
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	36,998	70,160.48	2,595,797,570	100,960.07	3,735,320,503	0.46
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	351,399	8,392.86	2,949,242,416	10,246.59	3,600,640,319	0.44
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	216,057	14,860.62	3,210,740,672	16,226.97	3,505,951,256	0.43
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	142,145	16,769.98	2,383,768,978	24,084.26	3,423,457,166	0.42
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	596,414	4,432.75	2,643,751,449	5,623.56	3,353,971,106	0.41
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	82,659	33,498.06	2,768,916,175	39,484.83	3,263,776,331	0.40

□ 種類別・業種別投資比率

2024年9月30日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式(外国)	エネルギー	3.99
	素材	3.69
	資本財	7.08
	商業・専門サービス	1.56
	運輸	1.52
	自動車・自動車部品	1.72
	耐久消費財・アパレル	1.33
	消費者サービス	1.89
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.76

	生活必需品流通・小売り	1.75
	食品・飲料・タバコ	3.10
	家庭用品・パーソナル用品	1.58
	ヘルスケア機器・サービス	4.02
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.66
	銀行	5.47
	金融サービス	6.67
	保険	3.10
	ソフトウェア・サービス	9.59
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.43
	半導体・半導体製造装置	8.80
	電気通信サービス	1.18
	公益事業	2.73
	メディア・娯楽	6.22
	不動産管理・開発	0.30
	新株予約権証券	-
	投資証券	-
	合計	98.18

## エマージング株式インデックス・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2024年9月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・ 半導体製 造装置	1,002,000	2,718.01	2,723,449,404	4,513.60	4,522,627,200	8.67
ケイマン 諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア ・娯楽	266,600	5,830.35	1,554,372,626	8,042.39	2,144,100,107	4.11
香港	投資信 託受益 証券	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	-	2,368,000	733.5089	1,736,949,012	813.7866	1,927,046,716	3.69
アメリカ	投資証 券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	-	299,238	5,709.79	1,708,587,017	6,181.64	1,849,780,483	3.55
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロ ジー・ ハード ウェアお よび機器	194,488	7,970.36	1,550,139,718	7,023.48	1,365,982,578	2.62
ケイマン 諸島	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	619,900	1,336.36	828,407,379	1,882.93	1,167,225,207	2.24
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネル ギー	124,068	4,230.61	524,883,545	5,219.52	647,575,221	1.24

ケイマン諸島	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	201,660	1,657.11	334,173,315	3,023.70	609,759,745	1.17
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI UAE ETF	-	256,688	2,111.97	542,117,056	2,202.32	565,310,117	1.08
ケイマン諸島	株式	PDD HOLDINGS INC	一般消費財・サービス流通・小売り	28,413	19,087.01	542,319,253	19,322.79	549,018,358	1.05
インド	株式	HDFC BANK LIMITED	銀行	174,052	2,702.74	470,417,416	2,997.03	521,639,326	1.00
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	212,839	1,648.20	350,802,114	2,234.29	475,543,197	0.91
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	22,327	14,892.56	332,506,256	20,107.72	448,945,064	0.86
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	135,071	2,539.53	343,016,728	3,260.54	440,404,736	0.84
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	509,800	483.13	246,300,629	862.10	439,497,356	0.84
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	3,933,000	84.23	331,266,434	110.04	432,772,767	0.83
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI QATAR ETF	-	141,785	2,477.84	351,320,744	2,624.80	372,157,934	0.71
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	62,000	4,435.41	274,995,367	5,687.14	352,602,432	0.68
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI KUWAIT ETF	-	70,532	4,331.91	305,537,978	4,655.85	328,386,595	0.63
インド	株式	BHARTI AIRTEL LTD	電気通信サービス	105,011	1,882.10	197,641,544	2,966.17	311,480,057	0.60
ケイマン諸島	株式	JD.COM INC-CLASS A	一般消費財・サービス流通・小売り	101,685	1,941.07	197,378,065	2,792.24	283,928,924	0.54
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	37,071	6,146.78	227,867,179	7,367.88	273,134,568	0.52
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	一般消費財・サービス流通・小売り	7,250	28,552.94	207,008,817	35,193.38	255,152,020	0.49
ケイマン諸島	株式	XIAOMI CORP-CLASS B	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	631,600	284.97	179,989,404	403.22	254,674,699	0.49

中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	2,850,000	70.53	201,003,749	86.52	246,589,695	0.47
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	269,500	659.37	177,698,881	892.78	240,604,749	0.46
ケイマン 諸島	株式	NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISL- A	銀行	120,588	2,139.52	258,000,763	1,979.67	238,723,855	0.46
ブラジ ル	株式	VALE SA	素材	139,888	1,894.33	264,993,656	1,678.69	234,828,273	0.45
インド ネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	2,231,900	85.48	190,784,632	101.18	225,812,482	0.43
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	3,266,000	53.55	174,881,884	68.52	223,786,646	0.43

□ 種別・業種別投資比率

2024年9月30日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式（外国）	エネルギー	3.81
	素材	4.96
	資本財	3.99
	商業・専門サービス	0.03
	運輸	1.58
	自動車・自動車部品	3.42
	耐久消費財・アパレル	1.06
	消費者サービス	2.59
	一般消費財・サービス流通・小売り	5.17
	生活必需品流通・小売り	1.14
	食品・飲料・タバコ	2.12
	家庭用品・パーソナル用品	0.69
	ヘルスケア機器・サービス	0.65
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイ エンス	2.28
	銀行	12.47
	金融サービス	2.30
	保険	2.53
	ソフトウェア・サービス	2.20
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.07
	半導体・半導体製造装置	11.27
電気通信サービス	2.04	
公益事業	2.18	
メディア・娯楽	5.88	
不動産管理・開発	0.98	
投資信託受益証券	-	3.69
投資証券	-	6.56
合計		92.67

## Jリート・インデックス・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2024年9月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	8,994	129,877.89	1,168,121,702	131,800.00	1,185,409,200	7.58
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,584	572,262.28	906,463,445	571,000.00	904,464,000	5.78
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	7,775	93,599.25	727,734,162	96,600.00	751,065,000	4.80
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	4,949	152,291.81	753,692,190	142,900.00	707,212,100	4.52
日本	投資証券	GLP投資法人	5,181	134,302.04	695,818,851	132,700.00	687,518,700	4.39
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	2,687	263,174.88	707,150,904	246,200.00	661,539,400	4.23
日本	投資証券	KDX不動産投資法人	4,315	158,733.48	684,934,953	151,200.00	652,428,000	4.17
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	2,314	240,614.62	556,782,221	235,500.00	544,947,000	3.48
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	8,503	64,016.70	544,333,973	62,100.00	528,036,300	3.37
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	1,516	334,528.78	507,145,633	336,500.00	510,134,000	3.26
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	3,452	145,103.06	500,895,776	138,100.00	476,721,200	3.05
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	3,076	155,377.90	477,942,414	153,600.00	472,473,600	3.02
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	5,673	73,240.27	415,492,069	71,500.00	405,619,500	2.59
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	1,056	331,812.10	350,393,575	348,500.00	368,016,000	2.35
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	4,641	83,231.98	386,279,617	76,000.00	352,716,000	2.25
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	533	663,746.88	353,777,086	638,000.00	340,054,000	2.17
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	2,828	124,637.78	352,475,650	119,600.00	338,228,800	2.16
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,037	263,583.10	273,335,670	274,100.00	284,241,700	1.82
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	1,970	148,836.19	293,207,293	143,300.00	282,301,000	1.80

日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	643	448,725.63	288,530,577	424,500.00	272,953,500	1.74
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	781	315,714.57	246,573,083	324,000.00	253,044,000	1.62
日本	投資証券	イオンリート投資法人	1,895	133,209.27	252,431,562	131,300.00	248,813,500	1.59
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	751	351,094.08	263,671,651	327,000.00	245,577,000	1.57
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	571	433,444.48	247,496,798	425,500.00	242,960,500	1.55
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	1,817	128,280.03	233,084,812	127,300.00	231,304,100	1.48
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	2,283	103,695.94	236,737,824	97,100.00	221,679,300	1.42
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	531	388,849.26	206,478,958	369,000.00	195,939,000	1.25
日本	投資証券	森トラストリート投資法人	2,977	67,653.13	201,403,367	65,200.00	194,100,400	1.24
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	1,364	143,047.02	195,116,142	139,000.00	189,596,000	1.21
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	621	309,500.00	192,199,500	302,500.00	187,852,500	1.20

## □ 種類別投資比率

2024年9月30日現在

種類	投資比率（％）
投資証券	98.48
合計	98.48

## 外国リート・インデックス・マザーファンド

### イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2024年9月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価（円）	帳簿価額（円）	評価額単価（円）	評価額（円）	投資比率（％）
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	172,985	18,382.18	3,179,840,807	17,925.46	3,100,835,819	7.35
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	17,691	118,444.45	2,095,400,774	125,986.34	2,228,824,406	5.28
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	108,285	17,037.68	1,844,925,189	18,155.26	1,965,941,895	4.66
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	29,340	48,750.21	1,430,331,149	50,903.23	1,493,500,686	3.54
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	163,207	8,723.44	1,423,726,280	8,953.45	1,461,266,187	3.46
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	57,409	23,764.55	1,364,298,763	23,937.25	1,374,213,487	3.26
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	57,209	21,720.65	1,242,616,745	23,002.37	1,315,942,402	3.12

オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	327,936	3,230.56	1,059,415,647	3,547.37	1,163,309,967	2.76
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	39,489	25,453.16	1,005,119,847	25,296.04	998,915,240	2.37
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	55,158	16,207.69	893,983,986	16,660.87	918,980,427	2.18
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	193,356	4,697.24	908,239,392	4,727.22	914,035,886	2.17
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	26,464	31,681.22	838,411,818	32,147.08	850,740,269	2.02
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	76,983	8,530.86	656,731,411	9,111.88	701,460,104	1.66
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	62,983	10,509.21	661,901,567	10,557.74	664,958,018	1.58
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	106,155	5,160.46	547,808,259	4,995.55	530,302,610	1.26
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,964	42,320.94	506,327,709	42,048.26	503,065,358	1.19
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	28,835	17,298.88	498,813,089	17,273.18	498,072,277	1.18
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	21,778	22,389.54	487,599,431	22,518.51	490,408,156	1.16
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	22,244	18,984.52	422,291,602	19,408.43	431,721,014	1.02
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	252,797	1,687.48	426,589,368	1,681.83	425,161,101	1.01
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	128,507	3,205.72	411,956,920	3,225.70	414,524,772	0.98
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	125,918	3,317.46	417,727,798	3,277.08	412,643,460	0.98
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	51,127	7,245.39	370,434,903	7,243.55	370,340,853	0.88
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	40,778	8,588.21	350,209,896	8,954.88	365,162,104	0.87
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	20,335	17,527.96	356,431,115	17,657.13	359,057,703	0.85
アメリカ	投資証券	UDR INC	55,893	6,180.21	345,430,421	6,421.42	358,912,578	0.85
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	960,992	333.71	320,690,141	362.34	348,204,976	0.83
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	34,434	10,042.48	345,802,852	10,099.57	347,768,758	0.82
香港	投資証券	LINK REIT	474,400	648.04	307,432,293	732.04	347,281,910	0.82
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	130,084	2,484.93	323,249,543	2,587.69	336,617,703	0.80

□ 種類別投資比率

2024年9月30日現在

種類	投資比率（％）
----	---------



投資証券	98.48
合計	98.48

## 投資不動産物件

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

該当事項はありません。

## 外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

## エマージング株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

## Jリート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

## 外国リート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2024年9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	230,000.00	33,402,971	32,813,870	0.09
	ユーロ	買建	140,000.00	22,491,831	22,313,200	0.06
	オーストラリア・ドル	買建	20,000.00	1,964,476	1,973,860	0.01
	メキシコ・ペソ	買建	270,000.00	1,978,322	1,954,341	0.01
	カナダ・ドル	買建	10,000.00	1,076,790	1,055,330	0.00
	デンマーク・クローネ	買建	10,000.00	215,469	213,740	0.00
	アメリカ・ドル	売建	118,110,000.00	17,116,557,245	16,850,635,590	45.09
	ユーロ	売建	69,470,000.00	11,158,055,251	11,072,128,600	29.63
	オフショア・人民元	売建	197,220,000.00	4,042,344,219	4,029,717,372	10.78
	イギリス・ポンド	売建	10,570,000.00	2,013,352,923	2,018,320,360	5.40
	カナダ・ドル	売建	6,880,000.00	740,241,648	726,067,040	1.94
	オーストラリア・ドル	売建	5,000,000.00	491,624,572	493,465,000	1.32

シンガポール・ドル	売建	3,040,000.00	338,519,497	338,771,520	0.91
メキシコ・ペソ	売建	36,490,000.00	267,650,821	264,125,567	0.71
ポーランド・ズロチ	売建	5,130,000.00	192,422,075	191,114,559	0.51
イスラエル・シケル	売建	2,910,000.00	116,330,735	111,339,219	0.30
ニュージーランド・ドル	売建	1,130,000.00	102,374,761	102,503,430	0.27
デンマーク・クローネ	売建	4,680,000.00	100,735,779	100,030,320	0.27
ノルウェー・クローネ	売建	4,230,000.00	57,914,153	57,506,850	0.15
スウェーデン・クローナ	売建	3,900,000.00	55,289,960	55,208,400	0.15

(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。

#### 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

2024年9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0612月2024年12月	買建	255	日本・円	6,732,100,500	6,751,125,000	2.01

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

#### 外国株式インデックス・マザーファンド

2024年9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 EUEX	FTSE 100 INDEX DEC 24	買建	43	イギリス・ポンド	3,600,816.00	687,863,880	3,601,680.00	688,028,930	0.08
	ドイツ	EUROSTOX	EURO STOXX 50 DEC 24	買建	293	ユーロ	14,459,053.50	2,305,206,899	14,934,210.00	2,380,961,100	0.29

アメリカ	シカゴ商品取引所	S & P 500 EMINENT DE C 24 2024年12月	買建	331	アメリカ・ドル	94,704,630.50	13,517,191,911	95,845,187.50	13,679,983,611	1.67
オーストラリア	シドニー先物取引所	S P I 200 FUTURE RES DEC 24 2024年12月	買建	22	オーストラリア・ドル	4,503,449.00	444,625,519	4,540,250.00	448,258,882	0.05

(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9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	20,911,000.00	3,006,897,373	2,983,527,703	0.36
	ユーロ	買建	1,937,000.00	311,431,080	308,734,023	0.04
	イギリス・ポンド	買建	1,037,000.00	200,095,781	198,027,353	0.02
	カナダ・ドル	買建	1,424,000.00	151,694,719	150,286,605	0.02
	スイス・フラン	買建	705,000.00	120,212,604	119,636,465	0.01
	スウェーデン・クローナ	買建	3,357,000.00	47,511,621	47,521,692	0.01
	デンマーク・クローネ	買建	2,049,000.00	43,787,949	43,795,326	0.01
	オーストラリア・ドル	買建	400,000.00	39,482,320	39,487,080	0.00

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

#### エマージング株式インデックス・マザーファンド

2024年9月30日現在

種類	国 / 地域	取引所等	名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価 (円)	評価額	時価 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	ICE-US	MSCI EMGMT DE C 24 2024年12月	買建	465	アメリカ・ドル	25,779,515.00	3,679,510,175	27,732,600.00	3,958,273,998	7.59

(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9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	872,822.41	124,500,000	124,524,700	0.24

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

## Jリート・インデックス・マザーファンド

2024年9月30日現在

種類	国/ 地域	取引所 等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
リート指 数先物取 引	日本	大阪取引 所	TREI T 先 物 0612 月 2024年 12月	買建	20	日本・円	35,002,400	34,350,000	0.22

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

## 外国リート・インデックス・マザーファンド

2024年9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	763,533.04	110,200,000	108,948,720	0.26
	オーストラリア・ドル	買建	71,806.48	7,200,000	7,087,680	0.02
	イギリス・ポンド	買建	33,339.13	6,500,000	6,366,950	0.02
	ユーロ	買建	34,470.66	5,600,000	5,494,509	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。

## 参考情報

基準日:2024年9月30日

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

※委託会社ホームページにおいてもファンドの運用状況は適宜開示しています。

## 基準価額・純資産の推移



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

## 分配の推移

決算期	分配金
2024年9月	0円
2023年9月	0円
2022年9月	0円
2021年9月	0円
2020年9月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

※直近5計算期間を記載しています。

## 主要な資産の状況

■三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	99.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.90
合計(純資産総額)		100.00

### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	19.95
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	19.68
日本	親投資信託受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	14.75
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	14.68
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	10.40
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	9.90
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	4.88
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	4.85

※比率は、ファンドの純資産総額に対する時価の比率です。

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

## ■国内債券パッシブ・マザーファンド

## 主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
日本	国債証券	150 5年国債	0.005	2026/12/20	1.88
日本	国債証券	461 2年国債	0.400	2026/06/01	1.46
日本	国債証券	375 10年国債	1.100	2034/06/20	1.28
日本	国債証券	154 5年国債	0.100	2027/09/20	0.88
日本	国債証券	369 10年国債	0.500	2032/12/20	0.88

## ■ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

## 主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.750	2026/05/31	0.73
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.670	2033/05/25	0.60
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	1.990	2026/03/15	0.60
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.040	2027/02/25	0.58
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.480	2028/09/25	0.57

## ■外国債券パッシブ・マザーファンド

## 主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2026/05/15	0.87
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.040	2027/02/25	0.86
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.390	2026/11/15	0.82
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2026/03/31	0.63
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.690	2026/08/12	0.57

\*比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

## ■国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

## 主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	3.56
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2.56
日本	株式	日立製作所	電気機器	2.42
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2.30
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.80

## ■外国株式インデックス・マザーファンド

## 主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.94
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4.50
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	4.45
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	2.63
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	1.85

## ■エマージング株式インデックス・マザーファンド

## 主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	8.67
ケイマン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	4.11
香港	投資信託受益証券	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	—	3.69
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	—	3.55
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.62

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

## ■Jリート・インデックス・マザーファンド

## 主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	7.58
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	5.78
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	4.80
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	4.52
日本	投資証券	GLP投資法人	4.39

## ■外国リート・インデックス・マザーファンド

## 主要投資銘柄(上位5銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	7.35
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	5.28
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	4.66
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	3.54
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	3.46

※比率は、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



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

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

※2024年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。

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

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込(販売)手続等】

## イ 申込方法

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

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

(ロ) 原則として午後3時30分までに、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。

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

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



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

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

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

## (二) 申込不可日

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

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

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

## ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

## ハ 申込手数料

ありません。

## ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社にお問い合わせください。

## ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

## ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

## ト 払込期日

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

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

## 2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

ただし、以下のいずれかに当たる場合には、解約請求の受け付けは行いません。

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

解約請求のお申込みに関しては、原則として午後3時30分までに、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。

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して6営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### イ 基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入れ有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます（基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。）。投資対象とする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、「DC世界分散」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

## （２）【保管】

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

## （３）【信託期間】

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

## （４）【計算期間】

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

## （５）【その他】

### イ 信託の終了

#### （イ）信託契約の解約

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

(ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令

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

(ハ) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

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

(ニ) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

ロ 収益分配金、償還金の支払い

(イ) 収益分配金

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

(ロ) 償還金

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

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、併合にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内

容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。

- (八) 上記(ロ)の書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使うことができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- (二) 書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います(書面決議は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。)
- (ホ) 上記(ロ)から(二)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。
- (へ) 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。

## 二 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

## ホ 販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約(名称の如何を問わず、ファンドの募集・販売の取扱い、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を規定するもの)は、期間満了の3ヵ月前に当事者のいずれからも、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。

## へ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

## ト 公告

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

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

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

## チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

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

## 4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

### イ 分配金請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に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て)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て)に支払われます。

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

#### ハ 一部解約実行請求権

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

#### ニ 書面決議における議決権

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

#### ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期(2023年9月12日から2024年9月10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つみたてNISA・世界分散ファンド】

## (1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第6期 (2023年 9月11日現在)	第7期 (2024年 9月10日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	636,228	182,937
コール・ローン	26,933,570	33,993,670
親投資信託受益証券	2,194,933,022	3,082,516,412
未収入金	3,200,000	-
流動資産合計	2,225,702,820	3,116,693,019
資産合計	2,225,702,820	3,116,693,019
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	5,928,762	1,240,103
未払受託者報酬	224,291	323,827
未払委託者報酬	2,131,087	3,076,799
その他未払費用	67,424	97,100
流動負債合計	8,351,564	4,737,829
負債合計	8,351,564	4,737,829
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,577,588,079	2,014,912,827
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	639,763,177	1,097,042,363
(分配準備積立金)	292,408,266	479,373,497
元本等合計	2,217,351,256	3,111,955,190
純資産合計	2,217,351,256	3,111,955,190
負債純資産合計	2,225,702,820	3,116,693,019



## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第6期		第7期	
	自 至	2022年 9月13日 2023年 9月11日	自 至	2023年 9月12日 2024年 9月10日
<b>営業収益</b>				
受取利息		282		16,795
有価証券売買等損益		110,936,389		237,641,390
営業収益合計		110,936,671		237,658,185
<b>営業費用</b>				
支払利息		11,936		3,450
受託者報酬		408,823		585,717
委託者報酬		3,884,560		5,565,164
その他費用		123,306		175,922
営業費用合計		4,428,625		6,330,253
営業利益又は営業損失（ ）		106,508,046		231,327,932
経常利益又は経常損失（ ）		106,508,046		231,327,932
当期純利益又は当期純損失（ ）		106,508,046		231,327,932
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		1,292,929		15,488,745
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		420,227,437		639,763,177
剰余金増加額又は欠損金減少額		155,127,399		317,086,063
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		155,127,399		317,086,063
剰余金減少額又は欠損金増加額		43,392,634		75,646,064
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		43,392,634		75,646,064
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（ ）		639,763,177		1,097,042,363

## （ 3 ）【注記表】

## （重要な会計方針の注記）

項 目	第7期	
	自 2023年9月12日 至 2024年9月10日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>計算期間の取扱い</p> <p>当計算期間は前期末が休日のため、2023年9月12日から2024年9月10日までとなっております。</p>	

## （重要な会計上の見積りに関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

項 目	第6期	第7期
	(2023年9月11日現在)	(2024年9月10日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,577,588,079口	2,014,912,827口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.4055円 (1万口当たりの純資産額14,055円)	1口当たり純資産額 1.5445円 (1万口当たりの純資産額15,445円)

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

項 目	第6期	第7期
	自 2022年9月13日 至 2023年9月11日	自 2023年9月12日 至 2024年9月10日

分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(42,217,881円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(65,583,094円)、収益調整金(347,354,911円)、および分配準備積立金(184,607,291円)より、分配対象収益は639,763,177円(1万口当たり4,055.32円)であります。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(61,676,166円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(154,163,021円)、収益調整金(617,668,866円)、および分配準備積立金(263,534,310円)より、分配対象収益は1,097,042,363円(1万口当たり5,444.61円)であります。分配を行っておりません。</p>
----------	--	---

## (金融商品に関する注記)

## ・金融商品の状況に関する事項

項目	<p style="text-align: center;">第7期 自 2023年9月12日 至 2024年9月10日</p>
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第7期 (2024年9月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第6期（自 2022年9月13日 至 2023年9月11日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	108,448,053円
合計	108,448,053円

## 第7期（自 2023年9月12日 至 2024年9月10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	231,369,927円
合計	231,369,927円

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第7期 自 2023年9月12日 至 2024年9月10日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## （その他の注記）

項 目	第6期 (2023年9月11日現在)	第7期 (2024年9月10日現在)
期首元本額	1,214,217,954円	1,577,588,079円
期中追加設定元本額	492,057,391円	620,093,815円
期中一部解約元本額	128,687,266円	182,769,067円

## （４）【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド（B号）	65,310,389	300,284,106	
	外国株式インデックス・マザーファンド	68,713,448	600,775,418	
	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	127,986,090	158,638,758	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	277,027,246	623,034,276	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	395,430,612	473,251,356	
	Jリート・インデックス・マザーファンド	61,188,113	160,196,598	
	外国リート・インデックス・マザーファンド	132,220,140	470,333,482	

エマージング株式インデックス・マ ザーファンド	149,533,932	296,002,418	
親投資信託受益証券 小計		3,082,516,412	
合 計		3,082,516,412	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

## 国内債券パッシブ・マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位：円)

(2024年9月10日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	3,128,106
コール・ローン	581,269,663
国債証券	107,066,741,760
地方債証券	11,555,289,150
特殊債券	10,119,577,191
社債券	7,819,165,700
未収入金	494,647,400
未収利息	385,615,643
前払費用	26,938,125
流動資産合計	138,052,372,738
資産合計	138,052,372,738
負債の部	
流動負債	
未払金	193,840,000
未払解約金	191,414,000
流動負債合計	385,254,000
負債合計	385,254,000
純資産の部	
元本等	
元本	115,030,780,551
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	22,636,338,187
元本等合計	137,667,118,738

純資産合計	137,667,118,738
負債純資産合計	138,052,372,738

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年9月12日 至 2024年9月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2024年9月10日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	115,030,780,551口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1968円 (1万口当たりの純資産額11,968円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年9月12日 至 2024年9月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券</p> <p>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2024年9月10日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>



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

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

自 2023年9月12日
至 2024年9月10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9月10日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	105,595,755,237円
同期中における追加設定元本額	29,561,115,792円
同期中における一部解約元本額	20,126,090,478円
2024年9月10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)	10,350,210,426円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	16,910,553,472円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	4,455,152,985円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	884,608,226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)	43,596,669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)	168,936,664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)	631,790,723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)	1,298,778,976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)	737,500,143円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	889,318,761円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	136,198,318円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	2,579,085,471円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,128,067,579円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	432,894,496円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	185,583,392円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	3,838,117,862円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,152,749,545円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	2,399,387,825円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	582,772,045円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	90,370,739円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	395,430,612円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	459,316,171円

三井住友D S ・年金バランス50 (標準型)	1,022,810,205円
三井住友D S ・年金バランス70 (株式重点型)	354,619,551円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2060	19,874,233円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2035	260,830,960円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2040	128,566,380円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2045	80,646,284円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2055	16,016,402円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2065	9,609,256円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル1 (保守型)	12,241,466円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル2 (安定型)	114,461,030円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル3 (安定成長型)	301,057,687円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル4 (成長型)	150,943,152円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル5 (積極成長型)	13,623,862円
S M A M ・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	997,067,571円
S M A M ・バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	7,470,835,609円
S M A M ・バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	5,903,455,290円
S M A M ・バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	15,450,099,037円
S M A M ・バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	299,682,684円
S M A M ・バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定>	492,021,940円
S M A M ・バランスファンドV A 7 5 <適格機関投資家専用>	284,234,196円
S M A M ・バランスファンドV L 国際分散型 <適格機関投資家限定>	122,911,810円
S M A M ・インデックス・バランスV A 2 5 <適格機関投資家専用>	1,819,907,465円
S M A M ・インデックス・バランスV A 5 0 <適格機関投資家専用>	2,237,429,887円
S M A M ・バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用>	2,089,514,792円
S M A M ・バランスファンドV A 3 5 <適格機関投資家専用>	7,305,090,400円
三井住友・国内債券インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	885,588,595円
S M A M ・グローバルバランス40 V A <適格機関投資家限定>	365,526,555円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 0 A <適格機関投資家専用>	418,802,557円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 3 5 A <適格機関投資家専用>	140,691,746円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 5 0 A <適格機関投資家専用>	54,178,432円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 0 L <適格機関投資家専用>	1,065,553,824円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 5 L <適格機関投資家専用>	1,916,502,820円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 <適格機関投資家専用>	533,900,866円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 <適格機関投資家専用>	228,840,970円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 <適格機関投資家専用>	26,228,031円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 3 0 L 2 <適格機関投資家専用>	235,562,227円
S M A M ・アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 <適格機関投資家専用>	4,485,859,238円
S M A M ・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	1,372,264,667円
S M A M ・マルチアセットストラテジーファンド2016 - 04 <適格機関投資家限定>	665,197,090円
S M A M ・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	1,061,464,793円
S M A M ・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド <適格機関投資家限定>	4,256,860,308円
S M D A M ・年金Wリスクコントロールファンド(リスク3%) <適格機関投資家限定>	609,785,583円
合 計	115,030,780,551円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	4 5 9 2年国債	1,960,000,000	1,955,139,200	
	4 6 0 2年国債	500,000,000	499,470,000	
	4 6 1 2年国債	2,000,000,000	2,001,020,000	
	4 6 2 2年国債	50,000,000	50,022,000	
	4 6 3 2年国債	350,000,000	350,098,000	
	1 4 8 5年国債	1,180,000,000	1,172,200,200	
	1 4 9 5年国債	1,090,000,000	1,081,563,400	
	1 5 0 5年国債	2,590,000,000	2,567,233,900	
	1 5 1 5年国債	100,000,000	99,014,000	
	1 5 2 5年国債	730,000,000	724,532,300	
	1 5 3 5年国債	800,000,000	791,224,000	
	1 5 4 5年国債	1,220,000,000	1,208,690,600	
	1 5 6 5年国債	1,180,000,000	1,171,799,000	
	1 5 7 5年国債	370,000,000	367,110,300	
	1 5 8 5年国債	880,000,000	870,073,600	
	1 5 9 5年国債	100,000,000	98,738,000	
	1 6 0 5年国債	690,000,000	683,852,100	
	1 6 1 5年国債	790,000,000	785,892,000	
	1 6 2 5年国債	220,000,000	218,607,400	
	1 6 3 5年国債	570,000,000	568,643,400	
	1 6 4 5年国債	240,000,000	237,235,200	
	1 6 5 5年国債	840,000,000	833,834,400	
	1 6 6 5年国債	440,000,000	438,614,000	
	1 6 7 5年国債	140,000,000	139,410,600	
	1 6 8 5年国債	760,000,000	763,526,400	
	1 6 9 5年国債	670,000,000	670,147,400	
	1 7 0 5年国債	610,000,000	612,409,500	
	1 7 1 5年国債	390,000,000	387,819,900	
	1 4 0年国債	40,000,000	43,820,800	
	2 4 0年国債	242,000,000	254,569,480	
	3 4 0年国債	185,000,000	193,374,950	
	4 4 0年国債	247,000,000	256,225,450	
	5 4 0年国債	235,000,000	232,727,550	
6 4 0年国債	240,000,000	231,230,400		
7 4 0年国債	265,000,000	243,023,550		
8 4 0年国債	330,000,000	278,487,000		
9 4 0年国債	543,000,000	330,328,620		
1 0 4 0年国債	500,000,000	357,460,000		
1 1 4 0年国債	380,000,000	259,114,400		

1 2	4 0 年国債	410,000,000	245,544,900	
1 3	4 0 年国債	555,000,000	325,352,100	
1 4	4 0 年国債	535,000,000	333,337,100	
1 5	4 0 年国債	550,000,000	377,839,000	
1 6	4 0 年国債	550,000,000	413,583,500	
1 7	4 0 年国債	240,000,000	233,820,000	
3 4 3	1 0 年国債	310,000,000	308,468,600	
3 4 4	1 0 年国債	811,000,000	806,271,870	
3 4 5	1 0 年国債	258,000,000	256,284,300	
3 4 6	1 0 年国債	340,000,000	337,453,400	
3 4 7	1 0 年国債	100,000,000	99,163,000	
3 4 8	1 0 年国債	145,000,000	143,655,850	
3 4 9	1 0 年国債	650,000,000	643,383,000	
3 5 0	1 0 年国債	510,000,000	504,247,200	
3 5 1	1 0 年国債	50,000,000	49,369,000	
3 5 2	1 0 年国債	150,000,000	147,865,500	
3 5 3	1 0 年国債	180,000,000	177,172,200	
3 5 4	1 0 年国債	265,000,000	260,312,150	
3 5 5	1 0 年国債	160,000,000	156,905,600	
3 5 6	1 0 年国債	530,000,000	519,097,900	
3 5 7	1 0 年国債	1,050,000,000	1,027,089,000	
3 5 8	1 0 年国債	930,000,000	908,544,900	
3 5 9	1 0 年国債	1,130,000,000	1,102,473,200	
3 6 0	1 0 年国債	850,000,000	827,934,000	
3 6 1	1 0 年国債	1,160,000,000	1,127,647,600	
3 6 2	1 0 年国債	1,180,000,000	1,144,765,200	
3 6 3	1 0 年国債	1,190,000,000	1,151,646,300	
3 6 4	1 0 年国債	1,120,000,000	1,081,158,400	
3 6 5	1 0 年国債	1,160,000,000	1,116,453,600	
3 6 6	1 0 年国債	1,180,000,000	1,141,508,400	
3 6 7	1 0 年国債	1,150,000,000	1,108,830,000	
3 6 8	1 0 年国債	1,110,000,000	1,067,020,800	
3 6 9	1 0 年国債	1,220,000,000	1,198,564,600	
3 7 0	1 0 年国債	1,220,000,000	1,195,563,400	
3 7 1	1 0 年国債	1,240,000,000	1,201,299,600	
3 7 2	1 0 年国債	1,050,000,000	1,050,000,000	
3 7 3	1 0 年国債	1,040,000,000	1,018,524,000	
3 7 4	1 0 年国債	1,000,000,000	994,280,000	
3 7 5	1 0 年国債	1,060,000,000	1,080,012,800	
2	3 0 年国債	440,000,000	484,303,600	
4	3 0 年国債	340,000,000	388,657,400	
5	3 0 年国債	290,000,000	320,760,300	
7	3 0 年国債	474,000,000	531,846,960	
9	3 0 年国債	240,000,000	253,039,200	
1 0	3 0 年国債	95,000,000	97,779,700	

1 1	3 0 年国債	430,000,000	463,810,900	
1 2	3 0 年国債	570,000,000	634,233,300	
1 4	3 0 年国債	392,000,000	446,891,760	
1 6	3 0 年国債	205,000,000	235,809,450	
1 8	3 0 年国債	190,000,000	215,045,800	
1 9	3 0 年国債	170,000,000	192,332,900	
2 1	3 0 年国債	345,000,000	390,239,850	
2 2	3 0 年国債	315,000,000	363,059,550	
2 3	3 0 年国債	349,000,000	402,442,370	
2 4	3 0 年国債	460,000,000	530,642,200	
2 5	3 0 年国債	260,000,000	294,057,400	
2 6	3 0 年国債	253,000,000	288,875,400	
2 7	3 0 年国債	250,000,000	288,230,000	
2 8	3 0 年国債	96,000,000	110,646,720	
2 9	3 0 年国債	157,000,000	178,650,300	
3 0	3 0 年国債	142,000,000	159,441,860	
3 1	3 0 年国債	235,000,000	260,112,100	
3 2	3 0 年国債	360,000,000	402,591,600	
3 3	3 0 年国債	208,000,000	223,165,280	
3 4	3 0 年国債	87,000,000	95,568,630	
3 5	3 0 年国債	260,000,000	277,253,600	
3 6	3 0 年国債	90,000,000	95,645,700	
3 7	3 0 年国債	225,000,000	234,936,000	
3 8	3 0 年国債	220,000,000	225,319,600	
3 9	3 0 年国債	220,000,000	228,373,200	
4 0	3 0 年国債	260,000,000	265,262,400	
4 1	3 0 年国債	240,000,000	240,523,200	
4 2	3 0 年国債	280,000,000	279,792,800	
4 3	3 0 年国債	295,000,000	293,911,450	
4 4	3 0 年国債	310,000,000	308,384,900	
4 5	3 0 年国債	315,000,000	301,858,200	
4 6	3 0 年国債	315,000,000	301,061,250	
4 7	3 0 年国債	370,000,000	359,081,300	
4 8	3 0 年国債	400,000,000	373,316,000	
4 9	3 0 年国債	395,000,000	367,583,050	
5 0	3 0 年国債	395,000,000	324,417,450	
5 1	3 0 年国債	355,000,000	258,557,150	
5 2	3 0 年国債	223,000,000	169,395,260	
5 3	3 0 年国債	297,000,000	229,913,640	
5 4	3 0 年国債	175,000,000	141,186,500	
5 5	3 0 年国債	285,000,000	228,980,400	
5 6	3 0 年国債	410,000,000	328,036,900	
5 7	3 0 年国債	425,000,000	338,623,000	
5 8	3 0 年国債	430,000,000	341,183,500	
5 9	3 0 年国債	420,000,000	323,937,600	

6 0	3 0 年国債	280,000,000	225,624,000	
6 1	3 0 年国債	295,000,000	225,335,750	
6 2	3 0 年国債	275,000,000	198,324,500	
6 3	3 0 年国債	230,000,000	160,402,000	
6 4	3 0 年国債	315,000,000	218,376,900	
6 5	3 0 年国債	295,000,000	203,461,500	
6 6	3 0 年国債	360,000,000	246,826,800	
6 7	3 0 年国債	410,000,000	295,782,200	
6 8	3 0 年国債	340,000,000	243,916,000	
6 9	3 0 年国債	460,000,000	337,801,000	
7 0	3 0 年国債	370,000,000	270,473,700	
7 1	3 0 年国債	390,000,000	283,783,500	
7 2	3 0 年国債	400,000,000	289,716,000	
7 3	3 0 年国債	410,000,000	295,593,600	
7 4	3 0 年国債	380,000,000	296,745,800	
7 5	3 0 年国債	330,000,000	277,602,600	
7 6	3 0 年国債	390,000,000	335,618,400	
7 7	3 0 年国債	360,000,000	324,324,000	
7 8	3 0 年国債	390,000,000	334,148,100	
7 9	3 0 年国債	390,000,000	316,816,500	
8 0	3 0 年国債	360,000,000	338,385,600	
8 1	3 0 年国債	340,000,000	304,487,000	
8 2	3 0 年国債	400,000,000	375,392,000	
8 3	3 0 年国債	280,000,000	286,969,200	
8 8	2 0 年国債	742,000,000	767,146,380	
8 9	2 0 年国債	20,000,000	20,642,600	
9 0	2 0 年国債	580,000,000	601,146,800	
9 2	2 0 年国債	324,000,000	336,486,960	
9 3	2 0 年国債	632,000,000	657,311,600	
9 5	2 0 年国債	305,000,000	320,933,200	
9 7	2 0 年国債	327,000,000	344,589,330	
9 9	2 0 年国債	153,000,000	161,378,280	
1 0 0	2 0 年国債	207,000,000	219,858,840	
1 0 1	2 0 年国債	355,000,000	379,516,300	
1 0 2	2 0 年国債	457,000,000	490,511,810	
1 0 5	2 0 年国債	370,000,000	394,209,100	
1 0 6	2 0 年国債	370,000,000	395,670,600	
1 0 7	2 0 年国債	378,000,000	403,983,720	
1 0 9	2 0 年国債	40,000,000	42,512,800	
1 1 1	2 0 年国債	386,000,000	416,586,640	
1 1 3	2 0 年国債	27,000,000	29,117,340	
1 1 4	2 0 年国債	163,000,000	176,400,230	
1 1 8	2 0 年国債	200,000,000	216,710,000	
1 1 9	2 0 年国債	295,000,000	316,248,850	
1 2 0	2 0 年国債	200,000,000	212,164,000	

1 2 1	2 0 年国債	55,000,000	59,433,550	
1 2 2	2 0 年国債	130,000,000	139,720,100	
1 2 3	2 0 年国債	70,000,000	76,673,100	
1 2 5	2 0 年国債	205,000,000	226,432,750	
1 2 6	2 0 年国債	180,000,000	196,489,800	
1 2 7	2 0 年国債	145,000,000	157,371,400	
1 2 8	2 0 年国債	65,000,000	70,660,200	
1 3 0	2 0 年国債	155,000,000	167,706,900	
1 3 1	2 0 年国債	80,000,000	86,018,400	
1 3 2	2 0 年国債	450,000,000	484,330,500	
1 3 3	2 0 年国債	190,000,000	205,817,500	
1 3 4	2 0 年国債	200,000,000	216,956,000	
1 3 5	2 0 年国債	155,000,000	166,967,550	
1 3 6	2 0 年国債	120,000,000	128,403,600	
1 3 7	2 0 年国債	185,000,000	199,370,800	
1 3 9	2 0 年国債	60,000,000	64,193,400	
1 4 0	2 0 年国債	420,000,000	452,768,400	
1 4 1	2 0 年国債	360,000,000	388,306,800	
1 4 2	2 0 年国債	240,000,000	260,748,000	
1 4 3	2 0 年国債	150,000,000	160,596,000	
1 4 4	2 0 年国債	170,000,000	180,572,300	
1 4 5	2 0 年国債	110,000,000	118,649,300	
1 4 6	2 0 年国債	195,000,000	210,213,900	
1 4 7	2 0 年国債	840,000,000	897,237,600	
1 4 8	2 0 年国債	459,000,000	485,704,620	
1 4 9	2 0 年国債	625,000,000	660,462,500	
1 5 0	2 0 年国債	691,000,000	722,433,590	
1 5 1	2 0 年国債	680,000,000	696,558,000	
1 5 2	2 0 年国債	640,000,000	654,048,000	
1 5 3	2 0 年国債	587,000,000	604,416,290	
1 5 4	2 0 年国債	600,000,000	610,098,000	
1 5 5	2 0 年国債	450,000,000	447,052,500	
1 5 6	2 0 年国債	400,000,000	370,420,000	
1 5 7	2 0 年国債	445,000,000	400,540,050	
1 5 8	2 0 年国債	430,000,000	399,629,100	
1 5 9	2 0 年国債	508,000,000	475,899,480	
1 6 0	2 0 年国債	445,000,000	420,320,300	
1 6 1	2 0 年国債	480,000,000	445,876,800	
1 6 2	2 0 年国債	640,000,000	592,076,800	
1 6 3	2 0 年国債	620,000,000	571,187,400	
1 6 4	2 0 年国債	535,000,000	484,110,800	
1 6 5	2 0 年国債	600,000,000	540,144,000	
1 6 6	2 0 年国債	545,000,000	502,037,650	
1 6 7	2 0 年国債	530,000,000	472,404,900	
1 6 8	2 0 年国債	520,000,000	454,230,400	

	169	20年国債	570,000,000	487,578,000	
	170	20年国債	1,015,000,000	863,531,550	
	171	20年国債	505,000,000	427,300,700	
	172	20年国債	500,000,000	427,525,000	
	173	20年国債	515,000,000	437,992,050	
	174	20年国債	690,000,000	583,643,400	
	175	20年国債	705,000,000	603,303,750	
	176	20年国債	750,000,000	638,445,000	
	177	20年国債	740,000,000	616,050,000	
	178	20年国債	630,000,000	530,882,100	
	179	20年国債	550,000,000	461,252,000	
	180	20年国債	540,000,000	475,351,200	
	181	20年国債	590,000,000	526,291,800	
	182	20年国債	660,000,000	607,035,000	
	183	20年国債	620,000,000	597,394,800	
	184	20年国債	570,000,000	520,358,700	
	185	20年国債	600,000,000	545,658,000	
	186	20年国債	480,000,000	466,195,200	
	187	20年国債	450,000,000	421,420,500	
	188	20年国債	450,000,000	442,107,000	
	189	20年国債	460,000,000	473,611,400	
		国債証券 小計		107,066,741,760	
地方債証券	755	東京都公債	400,000,000	397,746,000	
	1	東京都30年	100,000,000	111,397,100	
	8	東京都30年	400,000,000	440,404,000	
	13	東京都30年	500,000,000	518,393,500	
	6	東京都20年	100,000,000	100,896,000	
	26-15	北海道公債	100,000,000	100,077,200	
	30-8	北海道公債	200,000,000	197,666,400	
	30-18	北海道公債	200,000,000	196,145,000	
	226	神奈川県公債	200,000,000	198,477,600	
	3	神奈川県20年	100,000,000	101,383,600	
	7	神奈川県20年	100,000,000	104,300,000	
	13	神奈川県20年	100,000,000	108,262,400	
	89	神奈川県5年	200,000,000	198,066,400	
	392	大阪府公債	100,000,000	100,043,900	
	1	大阪府20年	200,000,000	215,679,400	
	173	大阪府5年	300,000,000	299,088,300	
	179	大阪府5年	100,000,000	99,435,900	
	193	大阪府5年	300,000,000	296,222,700	
	27-4	京都府公債	100,000,000	100,177,300	
	29-4	京都府公債	100,000,000	99,161,100	
	4	兵庫県公債15年	100,000,000	102,609,900	
	5	兵庫県公債15年	300,000,000	308,493,300	
	10	兵庫県公債20年	100,000,000	108,693,700	



27-8 静岡県公債	100,000,000	100,110,300	
7 静岡県30年	100,000,000	103,655,900	
1 静岡県20年	100,000,000	101,845,600	
22-8 愛知県20年	200,000,000	214,873,600	
27-16 愛知県公債	400,000,000	400,251,600	
27-7 埼玉県公債	300,000,000	300,250,200	
2 埼玉県公債	300,000,000	296,383,800	
5 埼玉県20年	100,000,000	106,386,800	
26-10 福岡県公債	100,000,000	100,086,800	
1-1 福岡県公債	200,000,000	194,704,400	
1-3 福岡県30年	100,000,000	68,733,400	
27-3 千葉県公債	100,000,000	100,156,900	
27-4 千葉県公債	100,000,000	100,225,000	
28-1 千葉県公債	100,000,000	99,369,200	
1-9 千葉県公債	200,000,000	193,740,000	
9 千葉県20年	200,000,000	214,395,400	
148 共同発行地方	350,000,000	350,647,850	
155 共同発行地方	100,000,000	99,705,300	
170 共同発行地方	400,000,000	396,618,400	
172 共同発行地方	500,000,000	496,108,000	
179 共同発行地方	100,000,000	99,071,800	
183 共同発行地方	600,000,000	592,555,800	
184 共同発行地方	300,000,000	295,801,800	
199 共同発行地方	100,000,000	97,194,700	
494 名古屋市債	200,000,000	200,166,800	
33 名古屋市5年	300,000,000	299,869,800	
3 名古屋市20年	100,000,000	101,323,300	
5 名古屋市20年	100,000,000	103,657,300	
1 京都市30年	100,000,000	114,792,900	
7 京都市20年	100,000,000	107,316,700	
26-17 神戸市公債	100,000,000	100,014,200	
4 横浜市20年	100,000,000	100,915,800	
7 横浜市20年	100,000,000	102,108,900	
9 横浜市20年	100,000,000	103,334,000	
14 横浜市20年	100,000,000	106,286,900	
27-5 札幌市公債	100,000,000	100,100,100	
2-7 札幌市公債	100,000,000	96,756,000	
94 川崎市公債	100,000,000	95,964,800	
2020-9 福岡市5年	100,000,000	99,494,200	
1-2 岡山県公債	100,000,000	97,494,200	
地方債証券 小計		11,555,289,150	
特殊債券			
47 日本政策投資CO	100,000,000	101,711,500	
124 日本政策投資	100,000,000	97,043,600	
36 日本政策投資B	100,000,000	104,449,200	
18 道路機構	100,000,000	115,146,300	

2 2	道路機構	300,000,000	334,274,400	
2 7	道路機構	100,000,000	105,396,200	
3 7	道路機構	300,000,000	320,121,300	
4 7	道路機構	200,000,000	215,772,200	
1 3 5	道路機構	200,000,000	202,498,800	
7 4	政保道路機構	100,000,000	105,860,400	
7 9	政保道路機構	200,000,000	213,961,800	
8 1	政保道路機構	200,000,000	214,232,800	
8 8	政保道路機構	100,000,000	110,987,600	
9 0	政保道路機構	500,000,000	537,710,000	
9 9	政保道路機構	100,000,000	108,519,100	
1 2 7	政保道路機構	200,000,000	217,102,200	
1 7 6	政保道路機構	100,000,000	106,755,100	
1 9 6	政保道路機構	100,000,000	107,823,600	
2 1 0	政保道路機構	200,000,000	211,134,400	
2 8 8	政保道路機構	189,000,000	187,245,891	
9	道路債券	100,000,000	115,247,200	
2	地方公営 2 0 年	100,000,000	107,421,300	
4	地方公共団 2 0 年	100,000,000	107,446,500	
1 8	地方公共団 2 0	300,000,000	320,677,200	
F 9 6	地方公共団体	100,000,000	102,328,100	
F 1 4 3	地方公共団体	100,000,000	102,267,200	
7 6	政保地方公共団	300,000,000	300,242,700	
8 5	地方公共団体	100,000,000	99,187,700	
1 0 1	地方公共団体	100,000,000	98,933,400	
1 0 6	地方公共団体	200,000,000	197,396,800	
2 9	地方公共団 5 年	300,000,000	297,006,900	
1 5	公営企業 2 0 年	100,000,000	101,765,800	
1 7	公営企業 2 0 年	100,000,000	102,880,700	
2 0	公営企業 2 0 年	100,000,000	104,221,600	
2 2	公営企業 2 0 年	100,000,000	104,817,000	
2 4	公営企業 2 0 年	200,000,000	212,147,800	
1 0	日本政策金融	100,000,000	107,968,900	
8 9	都市再生	100,000,000	101,949,800	
9 3	都市再生	100,000,000	102,022,500	
1 1 7	都市再生	100,000,000	100,480,200	
3 3	政保中部空港	200,000,000	198,362,400	
2 3 9	政保預金保険	600,000,000	598,851,000	
5 2	住宅支援機構	100,000,000	107,478,600	
9 3	住宅支援機構	100,000,000	102,238,200	
1 2 4	住宅支援機構	100,000,000	102,730,100	
1 3 0	住宅支援機構	200,000,000	213,690,200	
2 2 6	住宅支援機構	100,000,000	98,881,200	
S 1 1	住宅機構 R M B S	9,994,000	10,003,994	
1 9	住宅機構 R M B S	12,247,000	12,567,871	

2 4	住宅機構 R M B S	24,418,000	25,060,193	
2 6	住宅機構 R M B S	38,139,000	39,187,822	
2 7	住宅機構 R M B S	13,724,000	14,146,699	
2 8	住宅機構 R M B S	16,038,000	16,677,916	
2 9	住宅機構 R M B S	17,319,000	18,036,006	
3 0	住宅機構 R M B S	16,888,000	17,587,163	
3 2	住宅機構 R M B S	33,390,000	34,548,633	
3 5	住宅機構 R M B S	17,074,000	17,726,226	
3 6	住宅機構 R M B S	16,102,000	16,651,078	
4 3	住宅機構 R M B S	20,972,000	21,611,646	
4 6	住宅機構 R M B S	16,227,000	16,772,227	
4 8	住宅機構 R M B S	30,780,000	31,774,194	
4 9	住宅機構 R M B S	15,755,000	16,227,650	
5 1	住宅機構 R M B S	34,412,000	35,416,830	
5 5	住宅機構 R M B S	46,052,000	47,097,380	
5 7	住宅機構 R M B S	22,041,000	22,574,392	
5 8	住宅機構 R M B S	24,597,000	25,160,271	
5 9	住宅機構 R M B S	46,784,000	47,944,243	
6 0	住宅機構 R M B S	70,830,000	72,274,932	
6 1	住宅機構 R M B S	23,971,000	24,373,712	
6 7	住宅機構 R M B S	30,814,000	30,949,581	
6 9	住宅機構 R M B S	64,550,000	65,440,790	
7 0	住宅機構 R M B S	55,884,000	56,755,790	
7 3	住宅機構 R M B S	31,674,000	32,168,114	
9 9	住宅機構 R M B S	50,295,000	49,460,103	
1 2 3	住宅機構 R M B S	67,494,000	63,856,073	
1 2 4	住宅機構 R M B S	66,891,000	63,091,591	
1 2 5	住宅機構 R M B S	66,799,000	63,004,816	
1 2 7	住宅機構 R M B S	69,078,000	64,912,596	
1 2 8	住宅機構 R M B S	67,542,000	63,644,826	
1 2 9	住宅機構 R M B S	69,469,000	65,530,107	
1 3 7	住宅機構 R M B S	71,576,000	67,331,543	
1 6 7	住宅機構 R M B S	83,537,000	77,388,676	
1 8 3	住宅機構 R M B S	179,846,000	168,947,332	
1 8 6	住宅機構 R M B S	91,710,000	87,711,444	
1 9 8	住宅機構 R M B S	191,656,000	190,908,540	
8 5	中日本高速道	300,000,000	298,666,800	
	特殊債券 小計		10,119,577,191	
社債券	8 6 東日本高速道	200,000,000	197,583,200	
	1 1 4 東日本高速道	100,000,000	100,263,700	
	1 0 7 中日本高速道	200,000,000	200,423,800	
	8 4 西日本高速道	200,000,000	198,663,000	
	8 7 西日本高速道	200,000,000	200,154,600	
	1 3 大和ハウス	100,000,000	98,906,800	
	1 7 アサヒグループHD	200,000,000	197,856,200	

3 0	東レ	100,000,000	99,024,300	
1 2	旭化成	200,000,000	193,864,400	
2 4	三菱ケミカルホールデイ	100,000,000	98,721,600	
2 1	富士フィルムホールデイ	100,000,000	99,981,300	
3 2	住友電工	100,000,000	98,311,200	
1 6	小松製作所	100,000,000	98,384,100	
2 2	日立製作所	100,000,000	99,780,800	
9	T D K	100,000,000	97,415,000	
6 3	三井物産	100,000,000	104,340,900	
8	みずほコーポレート	100,000,000	105,283,600	
1	三井住友F G劣後	100,000,000	99,993,300	
8	住友信託 劣後	100,000,000	104,014,900	
9	みずほ銀行劣後	100,000,000	104,171,900	
1 7	N T Tファイナンス	200,000,000	197,227,000	
1 8	N T Tファイナンス	200,000,000	193,688,600	
7 3	ホンダファイナンス	200,000,000	197,507,000	
1 0 1	トヨタファイナンス	200,000,000	198,967,000	
2 0 7	オリックス	200,000,000	198,041,800	
2	三菱H C キャピタル	200,000,000	197,489,400	
5 8	三菱地所	100,000,000	113,349,700	
1 3 5	三菱地所	200,000,000	190,331,000	
1 0	東急	100,000,000	94,532,500	
3 8	京王電鉄	100,000,000	98,745,700	
1 1 0	東日本旅客鉄	100,000,000	94,311,900	
1 6 9	東日本旅客鉄	200,000,000	190,412,600	
2 6	西日本旅客鉄	100,000,000	107,864,200	
6 0	西日本旅客鉄	200,000,000	193,906,400	
4 1	東海旅客鉄道	100,000,000	105,997,800	
4 2	東海旅客鉄道	100,000,000	106,868,100	
4 5	東京地下鉄	200,000,000	192,967,600	
6 4	阪急阪神H L D G	100,000,000	98,783,600	
1 5	九州旅客鉄道	200,000,000	198,224,800	
3 1	K D D I	200,000,000	198,207,600	
5 4 6	中部電力	200,000,000	190,653,000	
5 5 3	中部電力	200,000,000	198,171,200	
5 5 0	関西電力	300,000,000	297,707,100	
5 6 0	関西電力	200,000,000	200,705,800	
5 0 8	東北電力	200,000,000	196,873,200	
5 4 7	東北電力	100,000,000	98,511,700	
4 9 6	九州電力	300,000,000	284,652,300	
5 6	東京電力P G	200,000,000	200,339,400	
6 6	東京電力P G	100,000,000	97,084,500	
4 1	大阪瓦斯	200,000,000	191,153,000	
7	ファーストリテイリング	100,000,000	98,751,600	
	社債券 小計		7,819,165,700	

合 計	136,560,773,801	
-----	-----------------	--

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位：円)

(2024年9月10日現在)

資産の部		
流動資産		
預金		49,937,632
金銭信託		1,022,303
コール・ローン		189,965,911
国債証券		35,546,814,431
派生商品評価勘定		577,451,124
未収利息		187,168,650
前払費用		93,946,239
流動資産合計		36,646,306,290
資産合計		36,646,306,290
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		1,011,526
未払金		3,868,615
未払解約金		4,750,000
流動負債合計		9,630,141
負債合計		9,630,141
純資産の部		
元本等		
元本		29,557,197,477
剰余金		
剰余金又は欠損金( )		7,079,478,672
元本等合計		36,636,676,149
純資産合計		36,636,676,149
負債純資産合計		36,646,306,290

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項 目	自 2023年9月12日 至 2024年9月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p>

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	(2024年9月10日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	29,557,197,477口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2395円 (1万口当たりの純資産額12,395円)

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年9月12日 至 2024年9月10日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券</p> <p>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引</p> <p>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p>

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

### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2024年9月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2024年9月10日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	33,402,971	-	32,900,810	502,161
	カナダ・ドル	1,076,790	-	1,054,963	21,827
	オーストラリア・ド ル	1,964,476	-	1,903,480	60,996
	デンマーク・クロー ネ	215,469	-	211,740	3,729
	メキシコ・ペソ	1,978,322	-	1,932,660	45,662
	ユーロ	22,491,831	-	22,114,680	377,151
	小計	61,129,859	-	60,118,333	1,011,526
	売建				
	アメリカ・ドル	16,732,171,605	-	16,510,484,740	221,686,865
	カナダ・ドル	721,263,640	-	706,825,210	14,438,430
	オーストラリア・ド ル	479,227,225	-	463,497,380	15,729,845
	シンガポール・ドル	327,561,347	-	322,194,600	5,366,747
	ニュージーランド・ ドル	98,855,597	-	95,643,467	3,212,130
	イギリス・ポンド	1,960,964,125	-	1,923,427,380	37,536,745
	イスラエル・シュケ ル	116,330,735	-	110,778,171	5,552,564
	デンマーク・クロー ネ	94,174,140	-	92,530,380	1,643,760
	ノルウェー・クロー ネ	57,914,153	-	55,800,891	2,113,262
	スウェーデン・ク ローナ	55,289,960	-	53,817,270	1,472,690
	メキシコ・ペソ	267,650,821	-	261,195,420	6,455,401
	オフショア・人民元	3,952,678,595	-	3,878,196,268	74,482,327
	ポーランド・ズロチ	192,422,075	-	189,142,074	3,280,001
	ユーロ	10,914,839,017	-	10,730,358,660	184,480,357
	小計	35,971,343,035	-	35,393,891,911	577,451,124
	合 計	36,032,472,894	-	35,454,010,244	576,439,598

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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



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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

自 2023年9月12日 至 2024年9月10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9月10日現在 )	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	15,785,182,828円
同期中における追加設定元本額	20,051,899,882円
同期中における一部解約元本額	6,279,885,233円
2024年9月10日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	2,011,510,031円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	2,203,165,599円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	848,422,165円
イオン・バランス戦略ファンド	1,250,820,715円
三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）	3,421,214,202円
三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）	1,573,946,740円
三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）	2,650,606,842円
三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）	730,726,946円
三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）	97,175,055円
三井住友・D C つみたてN I S A ・世界分散ファンド	127,986,090円
日興F W S ・先進国債インデックス（為替ヘッジあり）	335,397,294円
三井住友D S ・F W 専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）	14,903,918円
三井住友D S ・F W 専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）	139,067,152円
三井住友D S ・F W 専用ポートフォリオ・レベル3（安定成長型）	367,825,894円
三井住友D S ・F W 専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）	183,425,955円
三井住友D S ・F W 専用ポートフォリオ・レベル5（積極成長型）	16,859,938円
S M A M ・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	970,009,355円
S M A M ・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞	9,704,780,516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>	915,871,890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>	512,269,018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>	817,092,061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>	664,120,101円
合計	29,557,197,477円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	T 0.25 08/31/25	590,000.00	568,158.20	
		T 0.25 09/30/25	290,000.00	278,594.30	
		T 0.25 10/31/25	420,000.00	402,460.80	
		T 0.375 01/31/26	570,000.00	543,101.70	
		T 0.375 07/31/27	100,000.00	91,375.00	
		T 0.375 09/30/27	470,000.00	427,394.50	
		T 0.375 11/30/25	510,000.00	488,243.40	
		T 0.375 12/31/25	500,000.00	477,535.00	
		T 0.5 02/28/26	550,000.00	523,743.00	
		T 0.5 05/31/27	80,000.00	73,712.00	
		T 0.5 06/30/27	310,000.00	284,992.30	
		T 0.5 08/31/27	340,000.00	311,130.60	
		T 0.5 10/31/27	400,000.00	364,200.00	
		T 0.625 03/31/27	120,000.00	111,416.40	
		T 0.625 05/15/30	500,000.00	425,660.00	
		T 0.625 07/31/26	710,000.00	670,445.90	
		T 0.625 08/15/30	750,000.00	633,660.00	
		T 0.625 11/30/27	730,000.00	666,095.80	
		T 0.625 12/31/27	350,000.00	318,622.50	
		T 0.75 01/31/28	460,000.00	419,566.00	
		T 0.75 03/31/26	530,000.00	505,694.20	
		T 0.75 04/30/26	500,000.00	476,080.00	
		T 0.75 05/31/26	2,010,000.00	1,909,922.10	
		T 0.75 08/31/26	460,000.00	434,562.00	
		T 0.875 06/30/26	390,000.00	370,734.00	
		T 0.875 09/30/26	540,000.00	510,656.40	
		T 0.875 11/15/30	710,000.00	605,409.90	
		T 1.125 02/15/31	530,000.00	457,162.10	
		T 1.125 02/28/27	30,000.00	28,270.20	
		T 1.125 02/29/28	540,000.00	497,998.80	

T 1.125 05/15/40	630,000.00	421,677.90	
T 1.125 08/15/40	510,000.00	338,318.70	
T 1.125 08/31/28	650,000.00	592,819.50	
T 1.125 10/31/26	130,000.00	123,295.90	
T 1.25 03/31/28	460,000.00	425,247.00	
T 1.25 04/30/28	720,000.00	664,502.40	
T 1.25 05/15/50	500,000.00	274,450.00	
T 1.25 05/31/28	580,000.00	534,470.00	
T 1.25 06/30/28	330,000.00	303,553.80	
T 1.25 08/15/31	920,000.00	788,752.80	
T 1.25 09/30/28	570,000.00	521,601.30	
T 1.25 11/30/26	420,000.00	398,832.00	
T 1.25 12/31/26	850,000.00	806,386.50	
T 1.375 08/15/50	450,000.00	254,389.50	
T 1.375 08/31/26	240,000.00	229,579.20	
T 1.375 10/31/28	500,000.00	459,000.00	
T 1.375 11/15/31	1,040,000.00	894,452.00	
T 1.375 11/15/40	450,000.00	308,961.00	
T 1.375 12/31/28	510,000.00	466,828.50	
T 1.5 02/15/30	570,000.00	513,108.30	
T 1.5 11/30/28	380,000.00	350,162.40	
T 1.625 05/15/26	120,000.00	115,837.20	
T 1.625 05/15/31	230,000.00	203,414.30	
T 1.625 08/15/29	220,000.00	201,566.20	
T 1.625 09/30/26	110,000.00	105,629.70	
T 1.625 11/15/50	140,000.00	84,456.40	
T 1.625 11/30/26	350,000.00	335,125.00	
T 1.75 01/31/29	450,000.00	417,856.50	
T 1.75 08/15/41	810,000.00	581,507.10	
T 1.875 02/15/32	1,050,000.00	931,927.50	
T 1.875 02/15/41	320,000.00	237,555.20	
T 1.875 02/15/51	390,000.00	250,504.80	
T 1.875 02/28/27	530,000.00	508,757.60	
T 1.875 02/28/29	480,000.00	447,624.00	
T 1.875 06/30/26	200,000.00	193,562.00	
T 1.875 11/15/51	470,000.00	300,217.20	
T 2 02/15/50	570,000.00	379,694.10	
T 2 08/15/51	460,000.00	303,590.80	
T 2 11/15/26	490,000.00	473,286.10	
T 2 11/15/41	170,000.00	126,675.50	
T 2.125 05/31/26	320,000.00	311,360.00	
T 2.25 02/15/52	300,000.00	209,817.00	
T 2.25 03/31/26	700,000.00	683,522.00	
T 2.25 05/15/41	810,000.00	634,821.30	

T 2.25 08/15/46	250,000.00	182,322.50	
T 2.375 02/15/42	200,000.00	157,702.00	
T 2.375 03/31/29	90,000.00	85,699.80	
T 2.375 04/30/26	50,000.00	48,882.50	
T 2.375 05/15/29	100,000.00	95,115.00	
T 2.375 05/15/51	590,000.00	425,797.10	
T 2.375 11/15/49	580,000.00	420,859.60	
T 2.5 02/15/45	220,000.00	170,790.40	
T 2.5 02/15/46	220,000.00	169,193.20	
T 2.5 03/31/27	700,000.00	682,171.00	
T 2.5 05/15/46	230,000.00	176,407.70	
T 2.625 01/31/26	230,000.00	226,080.80	
T 2.625 05/31/27	180,000.00	175,667.40	
T 2.625 07/31/29	220,000.00	211,173.60	
T 2.625 12/31/25	110,000.00	108,177.30	
T 2.75 02/15/28	420,000.00	409,382.40	
T 2.75 04/30/27	1,140,000.00	1,116,880.80	
T 2.75 05/31/29	1,000,000.00	966,670.00	
T 2.75 07/31/27	350,000.00	342,405.00	
T 2.75 08/15/32	980,000.00	921,229.40	
T 2.75 08/15/42	230,000.00	191,481.90	
T 2.75 08/15/47	250,000.00	198,535.00	
T 2.75 11/15/47	250,000.00	198,152.50	
T 2.875 04/30/29	100,000.00	97,263.00	
T 2.875 05/15/32	850,000.00	807,908.00	
T 2.875 05/15/43	290,000.00	243,553.60	
T 2.875 05/15/49	590,000.00	474,855.60	
T 2.875 05/15/52	520,000.00	417,112.80	
T 2.875 08/15/28	300,000.00	292,890.00	
T 2.875 08/15/45	110,000.00	90,887.50	
T 3 02/15/48	360,000.00	298,321.20	
T 3 02/15/49	370,000.00	305,235.20	
T 3 05/15/45	290,000.00	245,015.20	
T 3 05/15/47	300,000.00	249,888.00	
T 3 08/15/48	500,000.00	413,300.00	
T 3 08/15/52	360,000.00	296,413.20	
T 3 09/30/25	620,000.00	612,994.00	
T 3 11/15/44	220,000.00	186,285.00	
T 3.125 02/15/42	150,000.00	133,218.00	
T 3.125 05/15/48	420,000.00	355,580.40	
T 3.125 08/15/44	320,000.00	276,940.80	
T 3.125 08/31/27	430,000.00	425,033.50	
T 3.125 08/31/29	870,000.00	854,122.50	
T 3.125 11/15/28	100,000.00	98,439.00	

T 3.125 11/15/41	210,000.00	187,530.00	
T 3.25 05/15/42	370,000.00	332,167.50	
T 3.25 06/30/27	100,000.00	99,230.00	
T 3.25 06/30/29	660,000.00	651,981.00	
T 3.375 05/15/33	720,000.00	704,656.80	
T 3.375 05/15/44	300,000.00	270,162.00	
T 3.375 08/15/42	330,000.00	300,943.50	
T 3.375 11/15/48	300,000.00	264,738.00	
T 3.5 01/31/28	980,000.00	979,323.80	
T 3.5 01/31/30	500,000.00	498,960.00	
T 3.5 02/15/33	1,020,000.00	1,008,739.20	
T 3.5 02/15/39	50,000.00	48,333.50	
T 3.5 04/30/28	800,000.00	799,608.00	
T 3.5 04/30/30	500,000.00	498,825.00	
T 3.625 02/15/44	270,000.00	252,555.30	
T 3.625 02/15/53	700,000.00	651,105.00	
T 3.625 03/31/28	730,000.00	732,832.40	
T 3.625 03/31/30	940,000.00	943,816.40	
T 3.625 05/15/26	830,000.00	827,983.10	
T 3.625 05/15/53	530,000.00	493,488.30	
T 3.625 05/31/28	400,000.00	401,504.00	
T 3.625 08/15/43	230,000.00	215,597.40	
T 3.75 04/15/26	440,000.00	439,678.80	
T 3.75 06/30/30	280,000.00	282,864.40	
T 3.75 08/15/27	300,000.00	301,746.00	
T 3.75 12/31/28	800,000.00	807,560.00	
T 3.75 12/31/30	350,000.00	353,552.50	
T 3.875 01/15/26	390,000.00	389,832.30	
T 3.875 02/15/43	450,000.00	438,763.50	
T 3.875 05/15/43	670,000.00	651,923.40	
T 3.875 08/15/33	800,000.00	811,952.00	
T 3.875 08/15/34	580,000.00	588,288.20	
T 3.875 08/15/40	40,000.00	39,942.80	
T 3.875 09/30/29	200,000.00	203,156.00	
T 3.875 11/30/27	410,000.00	414,296.80	
T 3.875 11/30/29	340,000.00	345,470.60	
T 3.875 12/31/27	260,000.00	262,938.00	
T 3.875 12/31/29	620,000.00	629,901.40	
T 4 01/15/27	1,190,000.00	1,200,448.20	
T 4 01/31/29	890,000.00	907,622.00	
T 4 01/31/31	670,000.00	686,260.90	
T 4 02/15/26	640,000.00	641,196.80	
T 4 02/15/34	1,300,000.00	1,331,382.00	
T 4 02/28/30	770,000.00	787,440.50	

T 4 02/29/28	600,000.00	609,456.00	
T 4 06/30/28	370,000.00	376,430.60	
T 4 07/31/29	700,000.00	715,470.00	
T 4 10/31/29	300,000.00	306,513.00	
T 4 11/15/42	300,000.00	298,095.00	
T 4 11/15/52	380,000.00	377,400.80	
T 4 12/15/25	300,000.00	300,123.00	
T 4.125 02/15/27	750,000.00	759,105.00	
T 4.125 03/31/29	700,000.00	718,032.00	
T 4.125 03/31/31	700,000.00	722,295.00	
T 4.125 06/15/26	900,000.00	905,724.00	
T 4.125 07/31/28	170,000.00	173,753.60	
T 4.125 07/31/31	600,000.00	619,686.00	
T 4.125 08/15/53	930,000.00	946,200.60	
T 4.125 09/30/27	880,000.00	895,408.80	
T 4.125 10/31/27	470,000.00	478,149.80	
T 4.125 11/15/32	1,010,000.00	1,045,087.40	
T 4.25 01/31/26	580,000.00	582,772.40	
T 4.25 02/15/54	1,290,000.00	1,342,296.60	
T 4.25 02/28/29	600,000.00	618,558.00	
T 4.25 02/28/31	750,000.00	779,130.00	
T 4.25 03/15/27	750,000.00	762,300.00	
T 4.25 05/15/39	70,000.00	73,269.70	
T 4.25 06/30/29	750,000.00	774,375.00	
T 4.25 06/30/31	650,000.00	676,097.50	
T 4.25 08/15/54	500,000.00	521,560.00	
T 4.25 11/15/40	140,000.00	146,039.60	
T 4.25 12/31/25	600,000.00	602,280.00	
T 4.375 05/15/34	1,060,000.00	1,117,717.00	
T 4.375 05/15/40	140,000.00	148,394.40	
T 4.375 07/15/27	600,000.00	613,332.00	
T 4.375 07/31/26	500,000.00	505,975.00	
T 4.375 08/15/26	500,000.00	506,365.00	
T 4.375 08/15/43	600,000.00	623,940.00	
T 4.375 08/31/28	900,000.00	928,503.00	
T 4.375 11/15/39	80,000.00	84,760.80	
T 4.375 11/30/28	400,000.00	413,420.00	
T 4.375 12/15/26	600,000.00	609,816.00	
T 4.5 02/15/36	50,000.00	54,046.50	
T 4.5 02/15/44	500,000.00	527,730.00	
T 4.5 03/31/26	1,000,000.00	1,010,050.00	
T 4.5 04/15/27	1,200,000.00	1,227,468.00	
T 4.5 05/15/27	800,000.00	818,872.00	
T 4.5 05/31/29	520,000.00	542,531.60	

T 4.5 07/15/26	750,000.00	760,320.00	
T 4.5 11/15/25	400,000.00	402,208.00	
T 4.5 11/15/33	960,000.00	1,020,672.00	
T 4.625 02/15/40	100,000.00	108,859.00	
T 4.625 02/28/26	500,000.00	505,455.00	
T 4.625 03/15/26	900,000.00	910,458.00	
T 4.625 04/30/29	900,000.00	942,777.00	
T 4.625 04/30/31	1,200,000.00	1,273,608.00	
T 4.625 05/15/44	700,000.00	750,750.00	
T 4.625 05/15/54	1,300,000.00	1,439,334.00	
T 4.625 05/31/31	600,000.00	637,038.00	
T 4.625 06/15/27	570,000.00	586,159.50	
T 4.625 06/30/26	700,000.00	710,661.00	
T 4.625 09/15/26	900,000.00	916,416.00	
T 4.625 09/30/28	470,000.00	489,552.00	
T 4.625 09/30/30	530,000.00	560,422.00	
T 4.625 10/15/26	900,000.00	917,397.00	
T 4.625 11/15/26	900,000.00	918,414.00	
T 4.75 11/15/43	980,000.00	1,068,964.40	
T 4.75 11/15/53	630,000.00	710,073.00	
T 4.875 04/30/26	1,000,000.00	1,016,950.00	
T 4.875 05/31/26	700,000.00	712,768.00	
T 4.875 10/31/28	900,000.00	946,827.00	
T 4.875 11/30/25	550,000.00	555,703.50	
アメリカ・ドル小計		120,840,000.00	115,841,941.10 (16,626,793,806)
カナダ・ドル	CAN 0.25 03/01/26	70,000.00	67,067.70
	CAN 0.5 09/01/25	180,000.00	174,871.80
	CAN 0.5 12/01/30	220,000.00	191,397.80
	CAN 1 06/01/27	140,000.00	133,616.00
	CAN 1.25 03/01/27	390,000.00	374,949.90
	CAN 1.25 06/01/30	150,000.00	137,923.50
	CAN 1.5 06/01/26	20,000.00	19,482.40
	CAN 1.5 06/01/31	290,000.00	266,765.20
	CAN 1.5 12/01/31	60,000.00	54,795.00
	CAN 1.75 12/01/53	350,000.00	260,648.50
	CAN 2 06/01/28	60,000.00	58,452.00
	CAN 2 06/01/32	400,000.00	376,412.00
	CAN 2 12/01/51	240,000.00	191,925.60
	CAN 2.25 06/01/29	60,000.00	58,903.80
	CAN 2.25 12/01/29	310,000.00	303,471.40
	CAN 2.5 12/01/32	110,000.00	107,081.70
	CAN 2.75 06/01/33	670,000.00	663,393.80
CAN 2.75 09/01/27	10,000.00	9,980.30	

	CAN 2.75 12/01/48	70,000.00	66,111.50	
	CAN 2.75 12/01/55	240,000.00	224,268.00	
	CAN 3 04/01/26	200,000.00	199,410.00	
	CAN 3 06/01/34	130,000.00	130,770.90	
	CAN 3 10/01/25	280,000.00	278,779.20	
	CAN 3.25 09/01/28	460,000.00	468,252.40	
	CAN 3.5 03/01/28	230,000.00	235,411.90	
	CAN 3.5 03/01/34	220,000.00	231,176.00	
	CAN 3.5 09/01/29	50,000.00	51,700.00	
	CAN 3.5 12/01/45	90,000.00	95,943.60	
	CAN 4 03/01/29	120,000.00	126,190.80	
	CAN 4 08/01/26	570,000.00	580,157.40	
	CAN 4.5 11/01/25	250,000.00	253,050.00	
	CAN 5 06/01/37	210,000.00	254,160.90	
	CANADA 2.75 12/01/64	120,000.00	112,778.40	
	カナダ・ドル小計	6,970,000.00	6,759,299.40 (714,998,692)	
オーストラ リア・ドル	ACGB 0.25 11/21/25	200,000.00	191,706.00	
	ACGB 0.5 09/21/26	430,000.00	404,088.20	
	ACGB 1 11/21/31	340,000.00	280,234.80	
	ACGB 1 12/21/30	560,000.00	475,176.80	
	ACGB 1.25 05/21/32	400,000.00	331,192.00	
	ACGB 1.5 06/21/31	190,000.00	164,355.70	
	ACGB 1.75 06/21/51	230,000.00	131,281.70	
	ACGB 1.75 11/21/32	200,000.00	170,174.00	
	ACGB 2.75 05/21/41	240,000.00	195,470.40	
	ACGB 2.75 06/21/35	50,000.00	44,559.00	
	ACGB 2.75 11/21/27	220,000.00	214,854.20	
	ACGB 2.75 11/21/28	440,000.00	426,527.20	
	ACGB 2.75 11/21/29	200,000.00	191,888.00	
	ACGB 3 03/21/47	210,000.00	166,002.90	
	ACGB 3 11/21/33	370,000.00	343,448.80	
	ACGB 3.25 04/21/29	130,000.00	128,239.80	
	ACGB 3.5 12/21/34	370,000.00	355,192.60	
	ACGB 3.75 04/21/37	90,000.00	87,201.00	
	ACGB 3.75 05/21/34	150,000.00	147,561.00	
	ACGB 4.25 04/21/26	130,000.00	131,159.60	
ACGB 4.25 06/21/34	170,000.00	174,095.30		
ACGB 4.75 04/21/27	80,000.00	82,380.80		
	オーストラリア・ドル小計	5,400,000.00	4,836,789.80 (461,671,586)	
シンガポ ール・ドル	SIGB 0.5 11/01/25	40,000.00	39,024.00	
	SIGB 1.25 11/01/26	100,000.00	97,572.00	
	SIGB 1.875 03/01/50	140,000.00	118,790.00	



	SIGB 1.875 10/01/51	30,000.00	25,192.50	
	SIGB 2.125 06/01/26	190,000.00	188,898.00	
	SIGB 2.25 08/01/36	250,000.00	240,250.00	
	SIGB 2.375 07/01/39	170,000.00	164,252.30	
	SIGB 2.625 05/01/28	200,000.00	201,420.00	
	SIGB 2.75 03/01/46	40,000.00	40,340.40	
	SIGB 2.875 07/01/29	150,000.00	153,045.00	
	SIGB 2.875 09/01/30	480,000.00	491,520.00	
	SIGB 3 04/01/29	110,000.00	112,644.40	
	SIGB 3 08/01/72	80,000.00	85,992.00	
	SIGB 3.25 06/01/54	100,000.00	111,134.00	
	SIGB 3.375 09/01/33	840,000.00	893,340.00	
	シンガポール・ドル小計	2,920,000.00	2,963,414.60 (325,442,191)	
ニュージー ランド・ド ル	NZGB 0.25 05/15/28	300,000.00	264,102.00	
	NZGB 0.5 05/15/26	70,000.00	66,059.70	
	NZGB 1.75 05/15/41	190,000.00	126,614.10	
	NZGB 2 05/15/32	340,000.00	292,750.20	
	NZGB 2.75 04/15/37	80,000.00	66,840.00	
	NZGB 2.75 05/15/51	30,000.00	21,105.00	
	NZGB 4.5 04/15/27	110,000.00	111,933.80	
	NZGB 4.5 05/15/30	80,000.00	82,310.40	
	NZGB 5 05/15/54	50,000.00	52,012.00	
	ニュージーランド・ドル小計	1,250,000.00	1,083,727.20 (95,400,505)	
イギリス・ ポンド	UK TSY GILT 1.125 01/31/39	190,000.00	128,934.00	
	UKT 0.125 01/30/26	320,000.00	305,132.80	
	UKT 0.125 01/31/28	170,000.00	151,558.40	
	UKT 0.25 07/31/31	210,000.00	167,061.30	
	UKT 0.375 10/22/26	270,000.00	251,926.20	
	UKT 0.375 10/22/30	350,000.00	288,645.00	
	UKT 0.5 01/31/29	600,000.00	525,078.00	
	UKT 0.5 10/22/61	140,000.00	44,618.00	
	UKT 0.625 07/31/35	70,000.00	49,858.20	
	UKT 0.625 10/22/50	260,000.00	110,682.00	
	UKT 0.875 01/31/46	550,000.00	286,385.00	
	UKT 0.875 10/22/29	160,000.00	140,067.20	
	UKT 1 01/31/32	170,000.00	140,569.60	
	UKT 1.125 10/22/73	90,000.00	34,731.00	
	UKT 1.25 07/22/27	130,000.00	121,598.10	
	UKT 1.25 07/31/51	90,000.00	45,855.00	
	UKT 1.25 10/22/41	590,000.00	377,812.40	
UKT 1.5 07/22/26	240,000.00	230,318.40		
UKT 1.5 07/22/47	110,000.00	64,669.00		

UKT 1.5 07/31/53	20,000.00	10,610.00	
UKT 1.625 10/22/28	70,000.00	64,890.00	
UKT 1.625 10/22/54	100,000.00	54,300.00	
UKT 1.625 10/22/71	130,000.00	62,283.00	
UKT 1.75 01/22/49	90,000.00	54,846.00	
UKT 1.75 07/22/57	120,000.00	66,036.00	
UKT 1.75 09/07/37	170,000.00	131,544.30	
UKT 2 09/07/25	30,000.00	29,372.40	
UKT 2.5 07/22/65	120,000.00	78,444.00	
UKT 3.25 01/22/44	90,000.00	77,247.00	
UKT 3.25 01/31/33	650,000.00	625,768.00	
UKT 3.5 01/22/45	120,000.00	106,176.00	
UKT 3.5 07/22/68	140,000.00	117,656.00	
UKT 3.5 10/22/25	100,000.00	99,213.00	
UKT 3.75 01/29/38	450,000.00	436,365.00	
UKT 3.75 03/07/27	520,000.00	518,455.60	
UKT 3.75 07/22/52	40,000.00	35,828.00	
UKT 3.75 10/22/53	380,000.00	338,580.00	
UKT 4 01/22/60	110,000.00	102,531.00	
UKT 4 10/22/63	350,000.00	325,101.00	
UKT 4.125 01/29/27	200,000.00	201,054.00	
UKT 4.125 07/22/29	230,000.00	234,045.70	
UKT 4.25 03/07/36	180,000.00	185,040.00	
UKT 4.25 06/07/32	140,000.00	145,285.00	
UKT 4.25 07/31/34	110,000.00	113,499.10	
UKT 4.25 09/07/39	80,000.00	80,832.00	
UKT 4.25 12/07/27	80,000.00	81,480.00	
UKT 4.25 12/07/49	90,000.00	87,930.00	
UKT 4.375 07/31/54	410,000.00	406,310.00	
UKT 4.5 06/07/28	220,000.00	225,682.60	
UKT 4.5 09/07/34	30,000.00	31,579.20	
UKT 4.5 12/07/42	50,000.00	51,345.00	
UKT 4.625 01/31/34	560,000.00	594,613.60	
UKT 4.75 10/22/43	420,000.00	442,890.00	
UKT 4.75 12/07/30	110,000.00	116,757.30	
UKT 4.75 12/07/38	410,000.00	438,987.00	
UKT 6 12/07/28	100,000.00	109,422.00	
イギリス・ポンド小計	11,930,000.00	10,347,498.40 (1,940,362,900)	
イスラエル・シェケル	ILGOV 0.5 02/27/26	290,000.00	274,853.30
	ILGOV 1 03/31/30	520,000.00	431,054.00
	ILGOV 1.3 04/30/32	500,000.00	392,650.00
	ILGOV 1.5 05/31/37	440,000.00	297,026.40
	ILGOV 1.75 08/31/25	150,000.00	146,617.50

	ILGOV 2 03/31/27	260,000.00	245,525.80	
	ILGOV 2.25 09/28/28	480,000.00	441,163.20	
	ILGOV 2.8 11/29/52	220,000.00	138,954.20	
	ILGOV 3.75 02/28/29	210,000.00	203,788.20	
	ILGOV 3.75 03/31/47	230,000.00	184,319.70	
	ILGOV 6.25 10/30/26	110,000.00	114,303.20	
	イスラエル・シュケル小計	3,410,000.00	2,870,255.50 (109,594,392)	
デンマーク・クローネ	DGB 0 11/15/31	770,000.00	669,722.90	
	DGB 0.25 11/15/52	390,000.00	226,262.40	
	DGB 0.5 11/15/27	570,000.00	544,840.20	
	DGB 0.5 11/15/29	820,000.00	761,829.20	
	DGB 1.75 11/15/25	340,000.00	337,977.00	
	DGB 2.25 11/15/33	650,000.00	658,489.00	
	DGB 4.5 11/15/39	910,000.00	1,160,887.00	
	デンマーク・クローネ小計	4,450,000.00	4,360,007.70 (92,519,363)	
ノルウェー・クローネ	NGB 1.25 09/17/31	390,000.00	344,475.30	
	NGB 1.375 08/19/30	680,000.00	617,909.20	
	NGB 1.5 02/19/26	370,000.00	360,069.20	
	NGB 1.75 02/17/27	790,000.00	764,664.70	
	NGB 1.75 09/06/29	170,000.00	159,730.30	
	NGB 2 04/26/28	620,000.00	597,897.00	
	NGB 2.125 05/18/32	200,000.00	186,152.00	
	NGB 3 08/15/33	810,000.00	797,679.90	
	NGB 3.5 10/06/42	310,000.00	320,195.90	
	NGB 3.625 04/13/34	70,000.00	72,110.50	
	ノルウェー・クローネ小計	4,410,000.00	4,220,884.00 (55,842,295)	
スウェーデン・クローナ	SGB 0.125 05/12/31	400,000.00	358,644.00	
	SGB 0.75 05/12/28	1,060,000.00	1,025,751.40	
	SGB 0.75 11/12/29	600,000.00	571,272.00	
	SGB 1 11/12/26	510,000.00	502,222.50	
	SGB 1.75 11/11/33	710,000.00	701,600.70	
	SGB 2.25 06/01/32	340,000.00	350,006.20	
	SGB 3.5 03/30/39	330,000.00	387,248.40	
	スウェーデン・クローナ小計	3,950,000.00	3,896,745.20 (53,891,986)	
メキシコ・ペソ	MBONO 5.5 03/04/27	3,100,000.00	2,836,872.00	
	MBONO 5.75 03/05/26	3,300,000.00	3,110,547.00	
	MBONO 7 09/03/26	1,000,000.00	951,750.00	
	MBONO 7.5 05/26/33	3,900,000.00	3,456,570.00	
	MBONO 7.5 06/03/27	2,800,000.00	2,674,756.00	
	MBONO 7.75 05/29/31	6,700,000.00	6,163,464.00	
	MBONO 7.75 11/13/42	2,500,000.00	2,055,225.00	

	MBONO 7.75 11/23/34	920,000.00	821,109.20	
	MBONO 8 05/24/35	3,500,000.00	3,112,655.00	
	MBONO 8 11/07/47	3,100,000.00	2,579,479.00	
	MBONO 8.5 03/01/29	3,300,000.00	3,190,968.00	
	MBONO 8.5 05/31/29	3,500,000.00	3,384,745.00	
	MBONO 8.5 11/18/38	1,900,000.00	1,728,620.00	
	メキシコ・ペソ小計	39,520,000.00	36,066,760.20 (260,138,721)	
オフショ ア・人民元	CGB 1.62 08/15/27	8,700,000.00	8,722,272.00	
	CGB 1.85 05/15/27	8,300,000.00	8,367,811.00	
	CGB 1.91 07/15/29	4,800,000.00	4,833,024.00	
	CGB 1.99 03/15/26	8,000,000.00	8,070,480.00	
	CGB 2.04 02/25/27	10,400,000.00	10,524,592.00	
	CGB 2.05 04/15/29	3,200,000.00	3,242,304.00	
	CGB 2.11 08/25/34	2,000,000.00	1,995,820.00	
	CGB 2.12 06/25/31	6,200,000.00	6,257,970.00	
	CGB 2.18 08/15/26	6,000,000.00	6,077,700.00	
	CGB 2.27 05/25/34	4,700,000.00	4,756,212.00	
	CGB 2.28 03/25/31	5,900,000.00	6,010,743.00	
	CGB 2.28 11/25/25	4,800,000.00	4,845,792.00	
	CGB 2.3 05/15/26	6,400,000.00	6,487,488.00	
	CGB 2.35 02/25/34	4,700,000.00	4,786,339.00	
	CGB 2.37 01/15/29	8,200,000.00	8,414,348.00	
	CGB 2.4 07/15/28	5,300,000.00	5,428,313.00	
	CGB 2.44 10/15/27	900,000.00	921,708.00	
	CGB 2.46 02/15/26	3,600,000.00	3,648,204.00	
	CGB 2.48 04/15/27	6,800,000.00	6,958,848.00	
	CGB 2.48 09/25/28	10,200,000.00	10,494,270.00	
	CGB 2.6 09/15/30	5,400,000.00	5,611,140.00	
	CGB 2.62 06/25/30	5,400,000.00	5,612,436.00	
	CGB 2.64 01/15/28	5,400,000.00	5,554,170.00	
	CGB 2.67 05/25/33	10,500,000.00	10,977,540.00	
	CGB 2.69 08/12/26	1,200,000.00	1,227,396.00	
	CGB 2.79 12/15/29	2,800,000.00	2,939,692.00	
	CGB 2.8 03/25/30	6,000,000.00	6,294,900.00	
	CGB 2.8 11/15/32	3,300,000.00	3,485,493.00	
	CGB 2.91 10/14/28	3,500,000.00	3,662,575.00	
	CGB 3 10/15/53	3,900,000.00	4,487,691.00	
	CGB 3.02 05/27/31	2,800,000.00	2,992,416.00	
	CGB 3.03 03/11/26	1,300,000.00	1,331,187.00	
	CGB 3.12 10/25/52	3,600,000.00	4,220,640.00	
	CGB 3.19 04/15/53	5,300,000.00	6,295,340.00	
	CGB 3.69 05/17/28	2,000,000.00	2,157,440.00	
	CGB 3.72 04/12/51	3,100,000.00	3,973,177.00	

オフショア・人民元小計		184,600,000.00	191,667,471.00 (3,860,374,533)	
ポーランド・ズロチ	POLGB 0 04/25/26	400,000.00	372,740.00	
	POLGB 0.25 10/25/26	520,000.00	474,208.80	
	POLGB 1.25 10/25/30	820,000.00	658,296.00	
	POLGB 1.75 04/25/32	270,000.00	213,111.00	
	POLGB 2.5 07/25/27	240,000.00	225,669.60	
	POLGB 2.75 04/25/28	50,000.00	46,575.00	
	POLGB 2.75 10/25/29	380,000.00	341,988.60	
	POLGB 3.75 05/25/27	680,000.00	662,360.80	
	POLGB 4.75 07/25/29	930,000.00	919,193.40	
	POLGB 5 10/25/34	140,000.00	136,949.40	
	POLGB 6 10/25/33	280,000.00	295,786.40	
	POLGB 7.5 07/25/28	690,000.00	751,251.30	
ポーランド・ズロチ小計		5,400,000.00	5,098,130.30 (188,766,941)	
ユーロ	BGB 0 10/22/27	150,000.00	139,722.00	
	BGB 0 10/22/31	10,000.00	8,369.70	
	BGB 0.1 06/22/30	370,000.00	323,812.90	
	BGB 0.35 06/22/32	150,000.00	126,387.00	
	BGB 0.4 06/22/40	390,000.00	259,435.80	
	BGB 0.65 06/22/71	30,000.00	13,131.00	
	BGB 0.8 06/22/27	270,000.00	259,227.00	
	BGB 0.8 06/22/28	280,000.00	265,045.20	
	BGB 0.9 06/22/29	160,000.00	149,568.00	
	BGB 1 06/22/26	40,000.00	39,055.60	
	BGB 1.25 04/22/33	50,000.00	44,843.00	
	BGB 1.4 06/22/53	200,000.00	129,548.00	
	BGB 1.45 06/22/37	20,000.00	16,838.40	
	BGB 1.6 06/22/47	100,000.00	73,753.00	
	BGB 1.7 06/22/50	30,000.00	21,792.60	
	BGB 1.9 06/22/38	60,000.00	52,556.40	
	BGB 2.75 04/22/39	320,000.00	309,795.20	
	BGB 2.85 10/22/34	50,000.00	50,343.50	
	BGB 3 06/22/33	240,000.00	246,309.60	
	BGB 3 06/22/34	140,000.00	143,348.80	
	BGB 3.45 06/22/43	400,000.00	414,528.00	
	BGB 3.5 06/22/55	50,000.00	50,956.00	
	BGB 3.75 06/22/45	100,000.00	107,932.00	
	BGB 4 03/28/32	130,000.00	142,446.20	
	BGB 4.5 03/28/26	150,000.00	154,644.00	
	BGB 5.5 03/28/28	80,000.00	88,608.80	
BKO 2.5 03/19/26	400,000.00	400,868.00		
BKO 2.7 09/17/26	470,000.00	474,483.80		

BKO 2.9 06/18/26	380,000.00	384,085.00	
BKO 3.1 09/18/25	140,000.00	140,635.60	
BTPS 0 04/01/26	60,000.00	57,595.80	
BTPS 0 08/01/26	200,000.00	190,418.00	
BTPS 0.25 03/15/28	180,000.00	165,326.40	
BTPS 0.45 02/15/29	170,000.00	153,304.30	
BTPS 0.5 02/01/26	260,000.00	252,194.80	
BTPS 0.6 08/01/31	50,000.00	42,175.00	
BTPS 0.85 01/15/27	120,000.00	115,304.40	
BTPS 0.9 04/01/31	260,000.00	226,088.20	
BTPS 0.95 06/01/32	330,000.00	278,807.10	
BTPS 0.95 08/01/30	520,000.00	461,619.60	
BTPS 0.95 09/15/27	210,000.00	199,836.00	
BTPS 0.95 12/01/31	100,000.00	85,685.00	
BTPS 1.1 04/01/27	130,000.00	125,187.40	
BTPS 1.35 04/01/30	170,000.00	155,840.70	
BTPS 1.45 03/01/36	20,000.00	15,933.00	
BTPS 1.5 04/30/45	130,000.00	85,385.30	
BTPS 1.6 06/01/26	130,000.00	127,809.50	
BTPS 1.65 03/01/32	20,000.00	17,960.40	
BTPS 1.8 03/01/41	120,000.00	89,258.40	
BTPS 2 02/01/28	190,000.00	185,863.70	
BTPS 2 12/01/25	220,000.00	218,077.20	
BTPS 2.05 08/01/27	160,000.00	157,464.00	
BTPS 2.1 07/15/26	150,000.00	148,665.00	
BTPS 2.15 03/01/72	140,000.00	87,165.40	
BTPS 2.15 09/01/52	100,000.00	68,181.00	
BTPS 2.25 09/01/36	170,000.00	146,958.20	
BTPS 2.45 09/01/50	280,000.00	208,101.60	
BTPS 2.5 11/15/25	20,000.00	19,945.60	
BTPS 2.5 12/01/32	290,000.00	273,617.90	
BTPS 2.65 12/01/27	270,000.00	269,946.00	
BTPS 2.7 03/01/47	150,000.00	121,006.50	
BTPS 2.8 03/01/67	90,000.00	67,387.50	
BTPS 2.8 06/15/29	250,000.00	248,950.00	
BTPS 2.8 12/01/28	20,000.00	20,024.80	
BTPS 2.95 02/15/27	530,000.00	533,725.90	
BTPS 2.95 09/01/38	200,000.00	181,412.00	
BTPS 3 08/01/29	120,000.00	120,621.60	
BTPS 3.1 03/01/40	220,000.00	199,669.80	
BTPS 3.1 08/28/26	390,000.00	393,077.10	
BTPS 3.25 03/01/38	350,000.00	329,444.50	
BTPS 3.25 09/01/46	90,000.00	79,920.90	
BTPS 3.35 07/01/29	430,000.00	438,157.10	

BTPS 3.4 04/01/28	420,000.00	429,370.20	
BTPS 3.45 03/01/48	10,000.00	9,093.80	
BTPS 3.45 07/15/27	400,000.00	408,400.00	
BTPS 3.45 07/15/31	370,000.00	375,635.10	
BTPS 3.5 01/15/26	80,000.00	80,757.60	
BTPS 3.5 02/15/31	170,000.00	173,428.90	
BTPS 3.6 09/29/25	220,000.00	221,544.40	
BTPS 3.7 06/15/30	270,000.00	278,961.30	
BTPS 3.8 04/15/26	510,000.00	518,705.70	
BTPS 3.85 02/01/35	150,000.00	153,385.50	
BTPS 3.85 07/01/34	510,000.00	523,984.20	
BTPS 3.85 09/01/49	10,000.00	9,620.80	
BTPS 3.85 12/15/29	410,000.00	427,498.80	
BTPS 4 04/30/35	30,000.00	31,223.40	
BTPS 4 10/30/31	120,000.00	126,423.60	
BTPS 4.05 10/30/37	350,000.00	360,447.50	
BTPS 4.1 02/01/29	100,000.00	105,062.00	
BTPS 4.15 10/01/39	400,000.00	410,668.00	
BTPS 4.2 03/01/34	200,000.00	211,680.00	
BTPS 4.4 05/01/33	360,000.00	388,076.40	
BTPS 4.45 09/01/43	580,000.00	610,084.60	
BTPS 4.5 03/01/26	130,000.00	133,342.30	
BTPS 4.5 10/01/53	200,000.00	210,440.00	
BTPS 4.75 09/01/28	200,000.00	214,676.00	
BTPS 5 08/01/34	170,000.00	191,250.00	
BTPS 5 08/01/39	220,000.00	247,387.80	
BTPS 5 09/01/40	180,000.00	202,174.20	
BTPS 5.25 11/01/29	250,000.00	277,880.00	
BTPS 5.75 02/01/33	310,000.00	363,809.80	
BTPS 6 05/01/31	130,000.00	152,473.10	
BTPS 6.5 11/01/27	190,000.00	212,030.50	
DBR 0 02/15/30	290,000.00	260,721.60	
DBR 0 02/15/31	350,000.00	308,297.50	
DBR 0 02/15/32	290,000.00	249,910.40	
DBR 0 05/15/35	140,000.00	110,887.00	
DBR 0 05/15/36	80,000.00	61,578.40	
DBR 0 08/15/26	220,000.00	211,246.20	
DBR 0 08/15/29	250,000.00	226,950.00	
DBR 0 08/15/30	260,000.00	231,462.40	
DBR 0 08/15/30	110,000.00	97,952.80	
DBR 0 08/15/31	200,000.00	174,366.00	
DBR 0 08/15/31	110,000.00	95,955.20	
DBR 0 08/15/50	100,000.00	53,959.00	
DBR 0 08/15/50	300,000.00	162,168.00	

DBR 0 08/15/52	140,000.00	72,245.60	
DBR 0 11/15/27	220,000.00	206,448.00	
DBR 0 11/15/28	310,000.00	285,730.10	
DBR 0.25 02/15/29	160,000.00	148,448.00	
DBR 0.25 08/15/28	100,000.00	93,577.00	
DBR 0.5 02/15/26	100,000.00	97,470.00	
DBR 0.5 02/15/28	100,000.00	95,154.00	
DBR 1 05/15/38	700,000.00	590,051.00	
DBR 1.25 08/15/48	120,000.00	94,353.60	
DBR 1.7 08/15/32	180,000.00	175,494.60	
DBR 1.8 08/15/53	390,000.00	339,600.30	
DBR 1.8 08/15/53	150,000.00	130,860.00	
DBR 2.1 11/15/29	220,000.00	220,688.60	
DBR 2.2 02/15/34	480,000.00	482,486.40	
DBR 2.3 02/15/33	390,000.00	396,513.00	
DBR 2.3 02/15/33	260,000.00	264,420.00	
DBR 2.4 11/15/30	250,000.00	254,947.50	
DBR 2.5 07/04/44	330,000.00	332,181.30	
DBR 2.5 08/15/46	230,000.00	231,616.90	
DBR 2.5 08/15/54	370,000.00	375,291.00	
DBR 2.6 05/15/41	380,000.00	388,219.40	
DBR 2.6 08/15/33	250,000.00	259,985.00	
DBR 2.6 08/15/34	170,000.00	176,488.90	
DBR 4 01/04/37	140,000.00	165,278.40	
DBR 4.25 07/04/39	90,000.00	110,657.70	
DBR 4.75 07/04/28	170,000.00	186,869.10	
DBR 4.75 07/04/40	130,000.00	169,695.50	
DBR 5.625 01/04/28	160,000.00	178,228.80	
DBR 6.25 01/04/30	130,000.00	157,241.50	
DBR 6.5 07/04/27	90,000.00	100,734.30	
FRANCE O.A.T. 0.75 05/25/53	450,000.00	236,169.00	
FRTR 0 02/25/26	310,000.00	298,951.60	
FRTR 0 02/25/27	900,000.00	848,691.00	
FRTR 0 05/25/32	890,000.00	726,952.00	
FRTR 0 11/25/29	540,000.00	474,881.40	
FRTR 0 11/25/30	1,130,000.00	966,409.90	
FRTR 0 11/25/31	630,000.00	522,868.50	
FRTR 0.25 11/25/26	650,000.00	619,989.50	
FRTR 0.5 05/25/26	270,000.00	261,289.80	
FRTR 0.5 05/25/29	400,000.00	364,996.00	
FRTR 0.5 05/25/40	640,000.00	431,187.20	
FRTR 0.5 05/25/72	80,000.00	30,471.20	
FRTR 0.5 06/25/44	300,000.00	181,623.00	
FRTR 0.75 02/25/28	950,000.00	897,664.50	



FRTR 0.75 05/25/28	390,000.00	367,029.00	
FRTR 0.75 05/25/52	180,000.00	96,948.00	
FRTR 0.75 11/25/28	370,000.00	345,062.00	
FRTR 1 11/25/25	200,000.00	196,174.00	
FRTR 1.25 05/25/34	110,000.00	95,410.70	
FRTR 1.25 05/25/36	270,000.00	224,580.60	
FRTR 1.25 05/25/38	460,000.00	365,796.60	
FRTR 1.5 05/25/50	230,000.00	157,943.30	
FRTR 1.75 05/25/66	120,000.00	78,519.60	
FRTR 1.75 06/25/39	160,000.00	134,763.20	
FRTR 2 11/25/32	530,000.00	502,477.10	
FRTR 2.5 05/25/30	210,000.00	209,685.00	
FRTR 2.5 05/25/43	940,000.00	840,745.40	
FRTR 2.5 09/24/26	820,000.00	820,984.00	
FRTR 2.5 09/24/27	150,000.00	150,301.50	
FRTR 2.75 02/25/29	920,000.00	929,761.20	
FRTR 2.75 02/25/30	450,000.00	454,369.50	
FRTR 2.75 10/25/27	470,000.00	474,563.70	
FRTR 3 05/25/33	500,000.00	509,305.00	
FRTR 3 05/25/54	140,000.00	129,183.60	
FRTR 3 06/25/49	380,000.00	360,338.80	
FRTR 3.25 05/25/45	280,000.00	279,302.80	
FRTR 3.25 05/25/55	250,000.00	240,970.00	
FRTR 3.5 04/25/26	240,000.00	243,751.20	
FRTR 3.5 11/25/33	590,000.00	623,281.90	
FRTR 4 04/25/60	60,000.00	67,257.00	
FRTR 4 10/25/38	210,000.00	231,865.20	
FRTR 4.5 04/25/41	280,000.00	327,577.60	
FRTR 4.75 04/25/35	100,000.00	116,828.00	
FRTR 5.5 04/25/29	340,000.00	383,730.80	
FRTR 5.75 10/25/32	140,000.00	170,639.00	
FRTR 6 10/25/25	180,000.00	186,521.40	
IRISH 0 10/18/31	50,000.00	42,321.50	
IRISH 0.2 05/15/27	100,000.00	94,789.00	
IRISH 0.2 10/18/30	120,000.00	105,831.60	
IRISH 0.35 10/18/32	160,000.00	135,766.40	
IRISH 0.9 05/15/28	170,000.00	162,146.00	
IRISH 1 05/15/26	30,000.00	29,322.00	
IRISH 1.1 05/15/29	50,000.00	47,415.50	
IRISH 1.35 03/18/31	40,000.00	37,621.60	
IRISH 1.5 05/15/50	100,000.00	75,097.00	
IRISH 1.7 05/15/37	60,000.00	53,458.20	
IRISH 2.4 05/15/30	80,000.00	80,348.00	
IRISH 2.6 10/18/34	50,000.00	50,119.50	

IRISH 3 10/18/43	120,000.00	122,355.60	
IRISH GOVT 0.55 04/22/41	60,000.00	42,051.00	
NETHER 0 01/15/26	100,000.00	96,874.00	
NETHER 0 01/15/27	230,000.00	218,780.60	
NETHER 0 01/15/29	330,000.00	300,131.70	
NETHER 0 01/15/38	220,000.00	155,586.20	
NETHER 0 01/15/52	80,000.00	39,959.20	
NETHER 0 07/15/30	340,000.00	298,584.60	
NETHER 0.25 07/15/29	60,000.00	54,665.40	
NETHER 0.5 01/15/40	340,000.00	249,424.00	
NETHER 0.5 07/15/26	100,000.00	96,907.00	
NETHER 0.5 07/15/32	40,000.00	34,813.20	
NETHER 0.75 07/15/27	190,000.00	182,734.40	
NETHER 0.75 07/15/28	150,000.00	142,168.50	
NETHER 2 01/15/54	120,000.00	104,328.00	
NETHER 2.5 01/15/33	100,000.00	101,013.00	
NETHER 2.5 07/15/33	380,000.00	383,002.00	
NETHER 2.5 07/15/34	70,000.00	70,266.00	
NETHER 2.75 01/15/47	80,000.00	81,460.00	
NETHER 3.25 01/15/44	290,000.00	315,111.10	
NETHER 4 01/15/37	110,000.00	126,426.30	
OBL 0 04/10/26	570,000.00	550,272.30	
OBL 0 04/16/27	360,000.00	341,406.00	
OBL 0 10/09/26	410,000.00	392,345.40	
OBL 0 10/10/25	100,000.00	97,379.00	
OBL 1.3 10/15/27	270,000.00	264,324.60	
OBL 1.3 10/15/27	70,000.00	68,527.90	
OBL 2.1 04/12/29	130,000.00	130,343.20	
OBL 2.1 04/12/29	380,000.00	381,124.80	
OBL 2.2 04/13/28	350,000.00	352,030.00	
OBL 2.4 10/19/28	350,000.00	354,903.50	
OBL 2.5 10/11/29	300,000.00	306,669.00	
RAGB 0 02/20/30	70,000.00	61,419.40	
RAGB 0 02/20/31	170,000.00	144,969.20	
RAGB 0 10/20/28	190,000.00	172,721.40	
RAGB 0 10/20/40	260,000.00	162,960.20	
RAGB 0.25 10/20/36	60,000.00	44,304.60	
RAGB 0.5 02/20/29	110,000.00	101,510.20	
RAGB 0.5 04/20/27	200,000.00	191,120.00	
RAGB 0.7 04/20/71	70,000.00	33,075.70	
RAGB 0.75 02/20/28	80,000.00	75,927.20	
RAGB 0.75 03/20/51	80,000.00	47,988.80	
RAGB 0.75 10/20/26	60,000.00	58,090.80	
RAGB 0.9 02/20/32	100,000.00	88,977.00	

RAGB 1.5 11/02/86	20,000.00	12,543.60	
RAGB 1.85 05/23/49	190,000.00	152,524.40	
RAGB 2.9 02/20/33	180,000.00	183,682.80	
RAGB 2.9 02/20/34	370,000.00	376,974.50	
RAGB 3.15 06/20/44	50,000.00	51,166.50	
RAGB 3.15 10/20/53	50,000.00	51,088.00	
RAGB 3.2 07/15/39	80,000.00	82,691.20	
RAGB 3.45 10/20/30	140,000.00	147,672.00	
RAGB 3.8 01/26/62	20,000.00	23,598.80	
RAGB 4.15 03/15/37	90,000.00	102,366.90	
RAGB 4.85 03/15/26	150,000.00	155,115.00	
RAGB 6.25 07/15/27	80,000.00	88,606.40	
RFGB 0 09/15/26	120,000.00	114,517.20	
RFGB 0 09/15/30	50,000.00	43,244.50	
RFGB 0.125 04/15/36	40,000.00	29,494.40	
RFGB 0.125 04/15/52	60,000.00	29,001.00	
RFGB 0.125 09/15/31	40,000.00	33,942.40	
RFGB 0.25 09/15/40	70,000.00	46,242.00	
RFGB 0.5 04/15/26	70,000.00	67,959.50	
RFGB 0.5 04/15/43	10,000.00	6,516.00	
RFGB 0.5 09/15/28	160,000.00	148,960.00	
RFGB 0.5 09/15/29	50,000.00	45,567.50	
RFGB 0.75 04/15/31	60,000.00	53,750.40	
RFGB 1.125 04/15/34	100,000.00	87,150.00	
RFGB 1.375 04/15/47	10,000.00	7,443.50	
RFGB 1.5 09/15/32	260,000.00	240,081.40	
RFGB 2.625 07/04/42	10,000.00	9,569.00	
RFGB 2.75 04/15/38	100,000.00	98,442.00	
RFGB 2.95 04/15/55	30,000.00	29,795.40	
RFGB 3 09/15/34	70,000.00	71,831.90	
SPGB 0 01/31/26	300,000.00	289,392.00	
SPGB 0 01/31/27	440,000.00	415,192.80	
SPGB 0 01/31/28	450,000.00	414,675.00	
SPGB 0.1 04/30/31	310,000.00	262,563.80	
SPGB 0.5 04/30/30	510,000.00	455,598.30	
SPGB 0.5 10/31/31	200,000.00	171,936.00	
SPGB 0.6 10/31/29	100,000.00	90,809.00	
SPGB 0.7 04/30/32	390,000.00	336,109.80	
SPGB 0.8 07/30/27	300,000.00	286,539.00	
SPGB 0.8 07/30/29	100,000.00	92,123.00	
SPGB 0.85 07/30/37	500,000.00	376,400.00	
SPGB 1 07/30/42	370,000.00	251,803.50	
SPGB 1 10/31/50	40,000.00	22,858.00	
SPGB 1.2 10/31/40	400,000.00	292,224.00	

SPGB 1.25 10/31/30	170,000.00	156,998.40	
SPGB 1.4 04/30/28	370,000.00	356,802.10	
SPGB 1.4 07/30/28	290,000.00	278,875.60	
SPGB 1.45 04/30/29	420,000.00	401,037.00	
SPGB 1.45 10/31/27	180,000.00	174,771.00	
SPGB 1.45 10/31/71	140,000.00	72,224.60	
SPGB 1.5 04/30/27	190,000.00	185,582.50	
SPGB 1.85 07/30/35	20,000.00	17,835.40	
SPGB 1.9 10/31/52	210,000.00	147,147.00	
SPGB 1.95 04/30/26	180,000.00	178,412.40	
SPGB 1.95 07/30/30	210,000.00	202,925.10	
SPGB 2.35 07/30/33	100,000.00	96,079.00	
SPGB 2.5 05/31/27	790,000.00	790,821.60	
SPGB 2.55 10/31/32	110,000.00	108,130.00	
SPGB 2.8 05/31/26	320,000.00	321,340.80	
SPGB 3.15 04/30/33	200,000.00	204,678.00	
SPGB 3.25 04/30/34	300,000.00	307,488.00	
SPGB 3.45 07/30/43	270,000.00	268,069.50	
SPGB 3.45 07/30/66	130,000.00	123,121.70	
SPGB 3.45 10/31/34	150,000.00	155,893.50	
SPGB 3.5 05/31/29	340,000.00	354,538.40	
SPGB 3.55 10/31/33	260,000.00	273,416.00	
SPGB 3.9 07/30/39	560,000.00	596,696.80	
SPGB 4 10/31/54	250,000.00	263,517.50	
SPGB 4.2 01/31/37	130,000.00	144,042.60	
SPGB 4.7 07/30/41	50,000.00	58,365.50	
SPGB 5.75 07/30/32	70,000.00	84,770.00	
SPGB 6 01/31/29	70,000.00	80,195.50	
ユーロ小計	72,320,000.00	67,965,745.70 (10,761,016,518)	
国債証券合計		35,546,814,431 (35,546,814,431)	
合計		35,546,814,431 (35,546,814,431)	

(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	230銘柄	45.4%	46.8%
カナダ・ドル	国債証券	33銘柄	2.0%	2.0%
オーストラリア・ドル	国債証券	22銘柄	1.3%	1.3%
シンガポール・ドル	国債証券	15銘柄	0.9%	0.9%
ニュージーランド・ドル	国債証券	9銘柄	0.3%	0.3%
イギリス・ポンド	国債証券	56銘柄	5.3%	5.5%
イスラエル・シケル	国債証券	11銘柄	0.3%	0.3%
デンマーク・クローネ	国債証券	7銘柄	0.3%	0.3%

ノルウェー・クローネ	国債証券	10銘柄	0.2%	0.2%
スウェーデン・クローナ	国債証券	7銘柄	0.1%	0.2%
メキシコ・ペソ	国債証券	13銘柄	0.7%	0.7%
オフショア・人民元	国債証券	36銘柄	10.5%	10.9%
ポーランド・ズロチ	国債証券	12銘柄	0.5%	0.5%
ユーロ	国債証券	320銘柄	29.4%	30.3%

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位：円)

(2024年9月10日現在)

資産の部		
流動資産		
預金		202,416,974
金銭信託		5,893,729
コール・ローン		1,095,182,160
国債証券		178,490,108,683
未収利息		1,295,795,742
前払費用		114,130,431
流動資産合計		181,203,527,719
資産合計		181,203,527,719
負債の部		
流動負債		
未払解約金		253,171,065
流動負債合計		253,171,065
負債合計		253,171,065
純資産の部		
元本等		
元本		80,456,963,120
剰余金		
剰余金又は欠損金( )		100,493,393,534
元本等合計		180,950,356,654
純資産合計		180,950,356,654
負債純資産合計		181,203,527,719

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年9月12日 至 2024年9月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p>

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	(2024年9月10日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	80,456,963,120口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2,249円 (1万口当たりの純資産額22,490円)

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年9月12日 至 2024年9月10日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券</p> <p>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引</p> <p>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p>

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

### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2024年9月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

自 2023年9月12日 至 2024年9月10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9月10日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	79,394,261,585円
同期中における追加設定元本額	13,713,455,436円
同期中における一部解約元本額	12,650,753,901円
2024年9月10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	28,382,220,411円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	1,002,073,370円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,523,871,866円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,532,824,942円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	118,967,029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)	5,567,516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)	21,970,186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)	80,585,426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)	252,816,462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)	211,076,276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)	354,153,036円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	19,508,134円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	38,612,613円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	64,743,524円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	40,503,731円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	52,122,910円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	394,400,984円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	272,850,257円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	800,274,081円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	261,559,099円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	143,088,978円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	277,027,246円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	1,337,041,193円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	44,539,158円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	151,428,714円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	121,439,101円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	7,143,031円
日興F W S・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	4,450,001,837円
三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド	329,834,076円



三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	14,525,527円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	9,259,484円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	10,235,234円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	5,738,283円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	3,455,386円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	1,120,762円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	3,765,382円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	18,685,645円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	18,586,871円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	7,167,837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>	5,298,754,919円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	18,176,913円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	3,470,206,369円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	3,386,540,500円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	8,192,791,778円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	25,374,037円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	64,513,915円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	652,639,659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>	94,448,421円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	787,304,796円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,169,912,566円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,107,463,148円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	3,286,663,120円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	5,705,155,001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)	268,645,076円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	95,826,153円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	50,442,563円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	22,317,166円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,781,731円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	56,501,585円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	304,304,665円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	60,667,510円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	35,582,152円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,723,530円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	692,755,925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>	445,487,788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>	580,475,822円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	219,399,292円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	195,107,235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>	149,601,796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>	90,241,775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>	143,958,855円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	149,555,150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>	233,856,611円
合計	80,456,963,120円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	T 0.25 09/30/25	2,000,000.00	1,921,340.00	
		T 0.25 10/31/25	1,000,000.00	958,240.00	
		T 0.375 01/31/26	2,500,000.00	2,382,025.00	
		T 0.375 07/31/27	900,000.00	822,375.00	
		T 0.375 09/30/27	1,000,000.00	909,350.00	
		T 0.375 11/30/25	2,000,000.00	1,914,680.00	
		T 0.375 12/31/25	3,000,000.00	2,865,210.00	
		T 0.5 04/30/27	1,200,000.00	1,108,188.00	
		T 0.5 05/31/27	2,500,000.00	2,303,500.00	
		T 0.5 06/30/27	2,600,000.00	2,390,258.00	
		T 0.5 10/31/27	1,000,000.00	910,500.00	
		T 0.625 03/31/27	2,400,000.00	2,228,328.00	
		T 0.625 05/15/30	5,000,000.00	4,256,600.00	
		T 0.625 07/31/26	800,000.00	755,432.00	
		T 0.625 08/15/30	4,800,000.00	4,055,424.00	
		T 0.625 11/30/27	3,400,000.00	3,102,364.00	
		T 0.625 12/31/27	5,600,000.00	5,097,960.00	
		T 0.75 01/31/28	5,900,000.00	5,381,390.00	
		T 0.75 04/30/26	1,500,000.00	1,428,240.00	
		T 0.75 05/31/26	2,000,000.00	1,900,420.00	
		T 0.75 08/31/26	1,500,000.00	1,417,050.00	
		T 0.875 06/30/26	2,000,000.00	1,901,200.00	
		T 0.875 09/30/26	2,500,000.00	2,364,150.00	
		T 0.875 11/15/30	4,900,000.00	4,178,181.00	
		T 1 07/31/28	2,900,000.00	2,636,593.00	
		T 1.125 02/15/31	5,700,000.00	4,916,649.00	
		T 1.125 02/28/27	2,000,000.00	1,884,680.00	
		T 1.125 05/15/40	1,650,000.00	1,104,394.50	
		T 1.125 08/15/40	3,100,000.00	2,056,447.00	
		T 1.125 08/31/28	3,500,000.00	3,192,105.00	
		T 1.125 10/31/26	3,700,000.00	3,509,191.00	
		T 1.25 05/15/50	3,100,000.00	1,701,590.00	
		T 1.25 05/31/28	3,000,000.00	2,764,500.00	
T 1.25 06/30/28	3,000,000.00	2,759,580.00			
T 1.25 08/15/31	5,200,000.00	4,458,168.00			
T 1.25 09/30/28	3,000,000.00	2,745,270.00			
T 1.25 11/30/26	4,200,000.00	3,988,320.00			

T 1.25 12/31/26	2,600,000.00	2,466,594.00	
T 1.375 08/15/50	4,500,000.00	2,543,895.00	
T 1.375 08/31/26	600,000.00	573,948.00	
T 1.375 10/31/28	3,000,000.00	2,754,000.00	
T 1.375 11/15/31	4,900,000.00	4,214,245.00	
T 1.375 11/15/40	3,500,000.00	2,403,030.00	
T 1.375 12/31/28	1,000,000.00	915,350.00	
T 1.5 01/31/27	3,400,000.00	3,238,228.00	
T 1.5 02/15/30	2,100,000.00	1,890,399.00	
T 1.5 11/30/28	4,500,000.00	4,146,660.00	
T 1.625 02/15/26	2,900,000.00	2,809,926.00	
T 1.625 05/15/26	11,450,000.00	11,052,799.50	
T 1.625 05/15/31	5,500,000.00	4,864,255.00	
T 1.625 08/15/29	3,750,000.00	3,435,787.50	
T 1.625 09/30/26	900,000.00	864,243.00	
T 1.625 11/15/50	3,200,000.00	1,930,432.00	
T 1.625 11/30/26	200,000.00	191,500.00	
T 1.75 01/31/29	3,300,000.00	3,064,281.00	
T 1.75 08/15/41	3,400,000.00	2,440,894.00	
T 1.75 11/15/29	1,300,000.00	1,192,308.00	
T 1.75 12/31/26	2,500,000.00	2,398,725.00	
T 1.875 02/15/32	5,300,000.00	4,704,015.00	
T 1.875 02/15/41	3,300,000.00	2,449,788.00	
T 1.875 02/15/51	3,800,000.00	2,440,816.00	
T 1.875 02/28/27	3,400,000.00	3,263,728.00	
T 1.875 02/28/29	2,800,000.00	2,611,140.00	
T 1.875 07/31/26	2,500,000.00	2,416,875.00	
T 1.875 11/15/51	3,300,000.00	2,107,908.00	
T 2 02/15/50	2,800,000.00	1,865,164.00	
T 2 08/15/51	2,900,000.00	1,913,942.00	
T 2 11/15/26	1,000,000.00	965,890.00	
T 2 11/15/41	2,800,000.00	2,086,420.00	
T 2.25 02/15/27	4,400,000.00	4,262,984.00	
T 2.25 02/15/52	1,700,000.00	1,188,963.00	
T 2.25 03/31/26	8,200,000.00	8,006,972.00	
T 2.25 05/15/41	3,000,000.00	2,351,190.00	
T 2.25 08/15/27	2,200,000.00	2,121,174.00	
T 2.25 08/15/46	1,950,000.00	1,422,115.50	
T 2.25 08/15/49	1,500,000.00	1,060,680.00	
T 2.25 11/15/25	4,000,000.00	3,919,200.00	
T 2.25 11/15/27	4,400,000.00	4,231,700.00	
T 2.375 02/15/42	2,800,000.00	2,207,828.00	
T 2.375 03/31/29	5,000,000.00	4,761,100.00	
T 2.375 05/15/27	3,000,000.00	2,908,710.00	

T 2.375 05/15/29	2,400,000.00	2,282,760.00	
T 2.375 05/15/51	3,900,000.00	2,814,591.00	
T 2.375 11/15/49	1,900,000.00	1,378,678.00	
T 2.5 02/15/45	1,400,000.00	1,086,848.00	
T 2.5 02/15/46	1,000,000.00	769,060.00	
T 2.5 02/28/26	2,100,000.00	2,059,554.00	
T 2.5 03/31/27	3,000,000.00	2,923,590.00	
T 2.5 05/15/46	1,000,000.00	766,990.00	
T 2.625 01/31/26	2,200,000.00	2,162,512.00	
T 2.625 02/15/29	1,800,000.00	1,734,768.00	
T 2.625 05/31/27	4,800,000.00	4,684,464.00	
T 2.625 07/31/29	1,100,000.00	1,055,868.00	
T 2.625 12/31/25	1,400,000.00	1,376,802.00	
T 2.75 02/15/28	5,300,000.00	5,166,016.00	
T 2.75 04/30/27	1,600,000.00	1,567,552.00	
T 2.75 05/31/29	1,400,000.00	1,353,338.00	
T 2.75 08/15/32	4,200,000.00	3,948,126.00	
T 2.75 08/15/42	1,000,000.00	832,530.00	
T 2.75 08/15/47	1,800,000.00	1,429,452.00	
T 2.75 08/31/25	3,400,000.00	3,353,964.00	
T 2.75 11/15/42	300,000.00	248,904.00	
T 2.75 11/15/47	1,500,000.00	1,188,915.00	
T 2.875 04/30/29	3,500,000.00	3,404,205.00	
T 2.875 05/15/28	3,500,000.00	3,422,125.00	
T 2.875 05/15/32	5,700,000.00	5,417,736.00	
T 2.875 05/15/43	1,200,000.00	1,007,808.00	
T 2.875 05/15/49	1,400,000.00	1,126,776.00	
T 2.875 05/15/52	3,200,000.00	2,566,848.00	
T 2.875 08/15/28	4,500,000.00	4,393,350.00	
T 2.875 08/15/45	800,000.00	661,000.00	
T 2.875 11/15/46	1,000,000.00	818,040.00	
T 2.875 11/30/25	2,500,000.00	2,466,725.00	
T 3 02/15/47	1,500,000.00	1,251,735.00	
T 3 02/15/48	2,400,000.00	1,988,808.00	
T 3 02/15/49	2,300,000.00	1,897,408.00	
T 3 05/15/42	800,000.00	693,808.00	
T 3 05/15/45	900,000.00	760,392.00	
T 3 05/15/47	1,700,000.00	1,416,032.00	
T 3 08/15/48	2,000,000.00	1,653,200.00	
T 3 08/15/52	3,000,000.00	2,470,110.00	
T 3 09/30/25	1,000,000.00	988,700.00	
T 3 10/31/25	2,600,000.00	2,570,126.00	
T 3 11/15/44	1,000,000.00	846,750.00	
T 3 11/15/45	800,000.00	674,280.00	

T 3.125 02/15/42	1,000,000.00	888,120.00	
T 3.125 02/15/43	1,800,000.00	1,575,630.00	
T 3.125 05/15/48	2,400,000.00	2,031,888.00	
T 3.125 08/15/44	700,000.00	605,808.00	
T 3.125 08/31/29	2,700,000.00	2,650,725.00	
T 3.125 11/15/28	2,900,000.00	2,854,731.00	
T 3.125 11/15/41	1,000,000.00	893,000.00	
T 3.25 05/15/42	2,200,000.00	1,975,050.00	
T 3.25 06/30/29	3,000,000.00	2,963,550.00	
T 3.375 05/15/33	5,500,000.00	5,382,795.00	
T 3.375 05/15/44	500,000.00	450,270.00	
T 3.375 08/15/42	2,000,000.00	1,823,900.00	
T 3.375 11/15/48	3,100,000.00	2,735,626.00	
T 3.5 01/31/28	1,000,000.00	999,310.00	
T 3.5 01/31/30	2,500,000.00	2,494,800.00	
T 3.5 02/15/33	4,200,000.00	4,153,632.00	
T 3.5 02/15/39	200,000.00	193,334.00	
T 3.5 04/30/28	3,000,000.00	2,998,530.00	
T 3.5 04/30/30	2,500,000.00	2,494,125.00	
T 3.625 02/15/44	300,000.00	280,617.00	
T 3.625 02/15/53	2,700,000.00	2,511,405.00	
T 3.625 03/31/28	3,000,000.00	3,011,640.00	
T 3.625 03/31/30	1,200,000.00	1,204,872.00	
T 3.625 05/15/26	2,500,000.00	2,493,925.00	
T 3.625 05/15/53	2,900,000.00	2,700,219.00	
T 3.625 05/31/28	2,000,000.00	2,007,520.00	
T 3.625 08/15/43	500,000.00	468,690.00	
T 3.75 04/15/26	3,300,000.00	3,297,591.00	
T 3.75 05/31/30	3,000,000.00	3,030,930.00	
T 3.75 06/30/30	4,400,000.00	4,445,012.00	
T 3.75 08/15/41	1,100,000.00	1,071,939.00	
T 3.75 11/15/43	700,000.00	667,373.00	
T 3.75 12/31/28	1,000,000.00	1,009,450.00	
T 3.75 12/31/30	2,400,000.00	2,424,360.00	
T 3.875 01/15/26	5,300,000.00	5,297,721.00	
T 3.875 02/15/43	2,600,000.00	2,535,078.00	
T 3.875 05/15/43	2,200,000.00	2,140,644.00	
T 3.875 08/15/33	5,000,000.00	5,074,700.00	
T 3.875 08/15/34	2,100,000.00	2,130,009.00	
T 3.875 08/15/40	500,000.00	499,285.00	
T 3.875 09/30/29	2,300,000.00	2,336,294.00	
T 3.875 12/31/27	4,400,000.00	4,449,720.00	
T 3.875 12/31/29	1,500,000.00	1,523,955.00	
T 4 01/15/27	4,900,000.00	4,943,022.00	

T 4 01/31/29	4,100,000.00	4,181,180.00	
T 4 02/15/26	2,000,000.00	2,003,740.00	
T 4 02/15/34	5,100,000.00	5,223,114.00	
T 4 02/28/30	1,500,000.00	1,533,975.00	
T 4 02/29/28	5,000,000.00	5,078,800.00	
T 4 06/30/28	3,000,000.00	3,052,140.00	
T 4 07/31/29	2,500,000.00	2,555,250.00	
T 4 07/31/30	2,200,000.00	2,251,304.00	
T 4 10/31/29	1,600,000.00	1,634,736.00	
T 4 11/15/42	2,000,000.00	1,987,300.00	
T 4 11/15/52	2,600,000.00	2,582,216.00	
T 4.125 02/15/27	5,500,000.00	5,566,770.00	
T 4.125 03/31/29	3,000,000.00	3,077,280.00	
T 4.125 03/31/31	2,000,000.00	2,063,700.00	
T 4.125 06/15/26	2,000,000.00	2,012,720.00	
T 4.125 07/31/28	1,000,000.00	1,022,080.00	
T 4.125 07/31/31	2,000,000.00	2,065,620.00	
T 4.125 08/15/53	3,100,000.00	3,154,002.00	
T 4.125 08/31/30	1,700,000.00	1,751,085.00	
T 4.125 10/31/27	3,500,000.00	3,560,690.00	
T 4.125 11/15/32	5,600,000.00	5,794,544.00	
T 4.25 01/31/26	3,300,000.00	3,315,774.00	
T 4.25 02/15/54	3,500,000.00	3,641,890.00	
T 4.25 02/28/29	2,500,000.00	2,577,325.00	
T 4.25 02/28/31	2,000,000.00	2,077,680.00	
T 4.25 03/15/27	3,900,000.00	3,963,960.00	
T 4.25 05/15/39	100,000.00	104,671.00	
T 4.25 08/15/54	1,100,000.00	1,147,432.00	
T 4.25 10/15/25	2,000,000.00	2,003,900.00	
T 4.25 11/15/40	600,000.00	625,884.00	
T 4.25 12/31/25	5,800,000.00	5,822,040.00	
T 4.375 05/15/34	5,500,000.00	5,799,475.00	
T 4.375 05/15/40	900,000.00	953,964.00	
T 4.375 05/15/41	300,000.00	316,908.00	
T 4.375 07/15/27	1,000,000.00	1,022,220.00	
T 4.375 07/31/26	2,600,000.00	2,631,070.00	
T 4.375 08/15/26	4,000,000.00	4,050,920.00	
T 4.375 08/15/43	2,000,000.00	2,079,800.00	
T 4.375 08/31/28	1,000,000.00	1,031,670.00	
T 4.375 11/15/39	300,000.00	317,853.00	
T 4.375 11/30/28	1,900,000.00	1,963,745.00	
T 4.375 11/30/30	1,900,000.00	1,984,892.00	
T 4.375 12/15/26	4,000,000.00	4,065,440.00	
T 4.5 02/15/44	2,100,000.00	2,216,466.00	

T 4.5 03/31/26	2,500,000.00	2,525,125.00	
T 4.5 05/15/38	1,200,000.00	1,293,324.00	
T 4.5 05/31/29	1,500,000.00	1,564,995.00	
T 4.5 07/15/26	3,900,000.00	3,953,664.00	
T 4.5 08/15/39	300,000.00	322,065.00	
T 4.5 11/15/25	3,800,000.00	3,820,976.00	
T 4.5 11/15/33	4,800,000.00	5,103,360.00	
T 4.625 02/15/40	1,000,000.00	1,088,590.00	
T 4.625 03/15/26	2,500,000.00	2,529,050.00	
T 4.625 04/30/29	2,500,000.00	2,618,825.00	
T 4.625 04/30/31	1,000,000.00	1,061,340.00	
T 4.625 05/15/44	700,000.00	750,750.00	
T 4.625 05/15/54	700,000.00	775,026.00	
T 4.625 05/31/31	2,900,000.00	3,079,017.00	
T 4.625 09/15/26	4,000,000.00	4,072,960.00	
T 4.625 09/30/28	2,500,000.00	2,604,000.00	
T 4.625 09/30/30	1,500,000.00	1,586,100.00	
T 4.625 10/15/26	2,300,000.00	2,344,459.00	
T 4.625 11/15/26	4,800,000.00	4,898,208.00	
T 4.75 02/15/41	900,000.00	994,248.00	
T 4.75 11/15/43	2,200,000.00	2,399,716.00	
T 4.75 11/15/53	3,300,000.00	3,719,430.00	
T 4.875 10/31/28	1,400,000.00	1,472,842.00	
T 4.875 11/30/25	1,200,000.00	1,212,444.00	
T 5.25 11/15/28	500,000.00	534,000.00	
T 5.375 02/15/31	320,000.00	354,224.00	
T 6 02/15/26	1,000,000.00	1,031,910.00	
T 6.125 11/15/27	1,000,000.00	1,078,590.00	
アメリカ・ドル小計		619,920,000.00	581,988,197.00 (83,532,765,915)
カナダ・ドル	CAN 0.5 09/01/25	2,300,000.00	2,234,473.00
	CAN 1 06/01/27	800,000.00	763,520.00
	CAN 1.25 03/01/27	400,000.00	384,564.00
	CAN 1.25 06/01/30	2,100,000.00	1,930,929.00
	CAN 1.5 06/01/26	2,600,000.00	2,532,712.00
	CAN 1.5 12/01/31	2,100,000.00	1,917,825.00
	CAN 1.75 12/01/53	1,100,000.00	819,181.00
	CAN 2 06/01/28	700,000.00	681,940.00
	CAN 2 06/01/32	2,000,000.00	1,882,060.00
	CAN 2.25 06/01/29	1,100,000.00	1,079,903.00
	CAN 2.25 12/01/29	1,600,000.00	1,566,304.00
	CAN 2.5 12/01/32	2,930,000.00	2,852,267.10
	CAN 2.75 06/01/33	1,800,000.00	1,782,252.00
	CAN 2.75 09/01/27	2,600,000.00	2,594,878.00

	CAN 2.75 12/01/48	1,300,000.00	1,227,785.00	
	CAN 2.75 12/01/55	800,000.00	747,560.00	
	CAN 3 04/01/26	400,000.00	398,820.00	
	CAN 3 10/01/25	900,000.00	896,076.00	
	CAN 3.25 12/01/33	880,000.00	904,490.40	
	CAN 3.5 03/01/34	300,000.00	315,240.00	
	CAN 3.5 12/01/45	1,200,000.00	1,279,248.00	
	CAN 4 06/01/41	1,300,000.00	1,458,145.00	
	CAN 4.5 11/01/25	1,800,000.00	1,821,960.00	
	CAN 5 06/01/37	400,000.00	484,116.00	
	CAN 5.75 06/01/29	250,000.00	283,685.00	
	CAN 5.75 06/01/33	300,000.00	365,151.00	
	CANADA 2.75 12/01/64	700,000.00	657,874.00	
	カナダ・ドル小計	34,660,000.00	33,862,958.50 (3,582,023,750)	
オーストラ リア・ドル	ACGB 0.25 11/21/25	1,150,000.00	1,102,309.50	
	ACGB 0.5 09/21/26	200,000.00	187,948.00	
	ACGB 1.25 05/21/32	1,300,000.00	1,076,374.00	
	ACGB 1.5 06/21/31	3,900,000.00	3,373,617.00	
	ACGB 1.75 06/21/51	500,000.00	285,395.00	
	ACGB 1.75 11/21/32	1,400,000.00	1,191,218.00	
	ACGB 2.25 05/21/28	1,300,000.00	1,242,709.00	
	ACGB 2.5 05/21/30	1,600,000.00	1,504,688.00	
	ACGB 2.75 05/21/41	600,000.00	488,676.00	
	ACGB 2.75 06/21/35	800,000.00	712,944.00	
	ACGB 2.75 11/21/27	1,200,000.00	1,171,932.00	
	ACGB 2.75 11/21/28	200,000.00	193,876.00	
	ACGB 2.75 11/21/29	1,800,000.00	1,726,992.00	
	ACGB 3 03/21/47	1,200,000.00	948,588.00	
	ACGB 3 11/21/33	900,000.00	835,416.00	
	ACGB 3.25 04/21/29	800,000.00	789,168.00	
	ACGB 3.25 06/21/39	2,000,000.00	1,792,720.00	
	ACGB 3.5 12/21/34	600,000.00	575,988.00	
	ACGB 3.75 04/21/37	1,100,000.00	1,065,790.00	
	ACGB 3.75 05/21/34	200,000.00	196,748.00	
ACGB 4.25 04/21/26	2,150,000.00	2,169,178.00		
ACGB 4.25 06/21/34	100,000.00	102,409.00		
ACGB 4.5 04/21/33	1,500,000.00	1,565,250.00		
	オーストラリア・ドル小計	26,500,000.00	24,299,933.50 (2,319,428,654)	
シンガポ ール・ドル	SIGB 0.5 11/01/25	200,000.00	195,120.00	
	SIGB 1.25 11/01/26	800,000.00	780,576.00	
	SIGB 1.625 07/01/31	300,000.00	283,833.00	
	SIGB 2.625 05/01/28	800,000.00	805,680.00	



	SIGB 2.625 08/01/32	200,000.00	201,360.00	
	SIGB 2.75 03/01/46	1,000,000.00	1,008,510.00	
	SIGB 2.75 04/01/42	550,000.00	554,125.00	
	SIGB 2.875 07/01/29	100,000.00	102,030.00	
	SIGB 2.875 09/01/30	600,000.00	614,400.00	
	SIGB 3.25 06/01/54	600,000.00	666,804.00	
	SIGB 3.375 05/01/34	200,000.00	213,356.00	
	SIGB 3.375 09/01/33	400,000.00	425,400.00	
	SIGB 3.5 03/01/27	880,000.00	902,968.00	
	シンガポール・ドル小計	6,630,000.00	6,754,162.00 (741,742,071)	
ニュージー ランド・ド ル	NZGB 0.5 05/15/26	200,000.00	188,742.00	
	NZGB 1.5 05/15/31	200,000.00	170,576.00	
	NZGB 1.75 05/15/41	1,200,000.00	799,668.00	
	NZGB 2 05/15/32	1,120,000.00	964,353.60	
	NZGB 2.75 05/15/51	500,000.00	351,750.00	
	NZGB 3 04/20/29	1,000,000.00	965,910.00	
	NZGB 4.25 05/15/34	250,000.00	250,292.50	
	NZGB 4.5 04/15/27	1,100,000.00	1,119,338.00	
	NZGB 4.5 05/15/30	720,000.00	740,793.60	
	ニュージーランド・ドル小計	6,290,000.00	5,551,423.70 (488,691,828)	
イギリス・ ボンド	UK TSY GILT 1.125 01/31/39	600,000.00	407,160.00	
	UKT 0.125 01/30/26	1,500,000.00	1,430,310.00	
	UKT 0.125 01/31/28	1,800,000.00	1,604,736.00	
	UKT 0.25 07/31/31	1,300,000.00	1,034,189.00	
	UKT 0.375 10/22/26	2,000,000.00	1,866,120.00	
	UKT 0.375 10/22/30	1,100,000.00	907,170.00	
	UKT 0.5 01/31/29	1,850,000.00	1,618,990.50	
	UKT 0.5 10/22/61	1,200,000.00	382,440.00	
	UKT 0.625 07/31/35	1,350,000.00	961,551.00	
	UKT 0.875 01/31/46	400,000.00	208,280.00	
	UKT 0.875 07/31/33	1,300,000.00	1,016,873.00	
	UKT 0.875 10/22/29	500,000.00	437,710.00	
	UKT 1 01/31/32	2,100,000.00	1,736,448.00	
	UKT 1.125 10/22/73	300,000.00	115,770.00	
	UKT 1.25 07/22/27	900,000.00	841,833.00	
	UKT 1.25 07/31/51	1,400,000.00	713,300.00	
	UKT 1.25 10/22/41	800,000.00	512,288.00	
	UKT 1.5 07/22/26	1,100,000.00	1,055,626.00	
	UKT 1.5 07/22/47	1,000,000.00	587,900.00	
	UKT 1.625 10/22/28	900,000.00	834,300.00	
UKT 1.625 10/22/54	500,000.00	271,500.00		
UKT 1.75 01/22/49	1,950,000.00	1,188,330.00		

UKT 1.75 09/07/37	700,000.00	541,653.00	
UKT 2 09/07/25	1,100,000.00	1,076,988.00	
UKT 2.5 07/22/65	1,600,000.00	1,045,920.00	
UKT 3.25 01/22/44	1,600,000.00	1,373,280.00	
UKT 3.25 01/31/33	2,400,000.00	2,310,528.00	
UKT 3.5 01/22/45	1,250,000.00	1,106,000.00	
UKT 3.5 07/22/68	1,300,000.00	1,092,520.00	
UKT 3.5 10/22/25	700,000.00	694,491.00	
UKT 3.75 01/29/38	1,100,000.00	1,066,670.00	
UKT 3.75 03/07/27	300,000.00	299,109.00	
UKT 3.75 07/22/52	1,200,000.00	1,074,840.00	
UKT 3.75 10/22/53	1,300,000.00	1,158,300.00	
UKT 4 01/22/60	1,300,000.00	1,211,730.00	
UKT 4 10/22/31	100,000.00	101,649.00	
UKT 4.125 01/29/27	1,700,000.00	1,708,959.00	
UKT 4.125 07/22/29	300,000.00	305,277.00	
UKT 4.25 03/07/36	700,000.00	719,600.00	
UKT 4.25 06/07/32	500,000.00	518,875.00	
UKT 4.25 07/31/34	450,000.00	464,314.50	
UKT 4.25 09/07/39	600,000.00	606,240.00	
UKT 4.25 12/07/27	1,200,000.00	1,222,200.00	
UKT 4.25 12/07/40	600,000.00	602,100.00	
UKT 4.25 12/07/46	1,500,000.00	1,471,350.00	
UKT 4.25 12/07/49	900,000.00	879,300.00	
UKT 4.25 12/07/55	1,700,000.00	1,653,760.00	
UKT 4.375 07/31/54	350,000.00	346,850.00	
UKT 4.5 06/07/28	550,000.00	564,206.50	
UKT 4.5 09/07/34	400,000.00	421,056.00	
UKT 4.5 12/07/42	1,050,000.00	1,078,245.00	
UKT 4.625 01/31/34	1,800,000.00	1,911,258.00	
UKT 4.75 10/22/43	700,000.00	738,150.00	
UKT 4.75 12/07/30	1,000,000.00	1,061,430.00	
UKT 4.75 12/07/38	1,000,000.00	1,070,700.00	
UKT 6 12/07/28	650,000.00	711,243.00	
イギリス・ボンド小計	59,450,000.00	51,941,616.50 (9,740,091,926)	
イスラエル・シュケル	ILGOV 1 03/31/30	1,400,000.00	1,160,530.00
	ILGOV 1.3 04/30/32	1,000,000.00	785,300.00
	ILGOV 1.5 05/31/37	1,200,000.00	810,072.00
	ILGOV 2 03/31/27	1,500,000.00	1,416,495.00
	ILGOV 2.25 09/28/28	1,900,000.00	1,746,271.00
	ILGOV 3.75 02/28/29	500,000.00	485,210.00
	ILGOV 3.75 03/31/47	3,600,000.00	2,885,004.00
	ILGOV 3.75 09/30/27	1,000,000.00	981,980.00

	ILGOV 4 03/30/35	500,000.00	464,980.00	
	ILGOV 6.25 10/30/26	3,300,000.00	3,429,096.00	
	イスラエル・シュケル小計	15,900,000.00	14,164,938.00 (540,856,995)	
デンマーク・クローネ	DGB 0 11/15/31	500,000.00	434,885.00	
	DGB 0.25 11/15/52	1,800,000.00	1,044,288.00	
	DGB 0.5 11/15/27	6,100,000.00	5,830,746.00	
	DGB 0.5 11/15/29	5,400,000.00	5,016,924.00	
	DGB 1.75 11/15/25	100,000.00	99,405.00	
	DGB 2.25 11/15/33	1,200,000.00	1,215,672.00	
	DGB 4.5 11/15/39	7,000,000.00	8,929,900.00	
	デンマーク・クローネ小計	22,100,000.00	22,571,820.00 (478,974,020)	
ノルウェー・クローネ	NGB 1.375 08/19/30	4,200,000.00	3,816,498.00	
	NGB 1.5 02/19/26	1,700,000.00	1,654,372.00	
	NGB 1.75 02/17/27	700,000.00	677,551.00	
	NGB 1.75 09/06/29	5,000,000.00	4,697,950.00	
	NGB 2 04/26/28	5,900,000.00	5,689,665.00	
	NGB 3 08/15/33	1,100,000.00	1,083,269.00	
	NGB 3.5 10/06/42	2,300,000.00	2,375,647.00	
	NGB 3.625 04/13/34	1,000,000.00	1,030,150.00	
	ノルウェー・クローネ小計	21,900,000.00	21,025,102.00 (278,162,099)	
スウェーデン・クローナ	SGB 0.125 05/12/31	500,000.00	448,305.00	
	SGB 0.75 05/12/28	3,700,000.00	3,580,453.00	
	SGB 0.75 11/12/29	4,200,000.00	3,998,904.00	
	SGB 1 11/12/26	6,400,000.00	6,302,400.00	
	SGB 1.75 11/11/33	400,000.00	395,268.00	
	SGB 3.5 03/30/39	4,900,000.00	5,750,052.00	
	スウェーデン・クローナ小計	20,100,000.00	20,475,382.00 (283,174,533)	
メキシコ・ペソ	MBONO 5.5 03/04/27	15,000,000.00	13,726,800.00	
	MBONO 5.75 03/05/26	19,000,000.00	17,909,210.00	
	MBONO 7.5 05/26/33	6,000,000.00	5,317,800.00	
	MBONO 7.5 06/03/27	22,000,000.00	21,015,940.00	
	MBONO 7.75 05/29/31	27,000,000.00	24,837,840.00	
	MBONO 7.75 11/23/34	18,000,000.00	16,065,180.00	
	MBONO 8 11/07/47	13,000,000.00	10,817,170.00	
	MBONO 8.5 05/31/29	37,000,000.00	35,781,590.00	
	MBONO 8.5 11/18/38	40,000,000.00	36,392,000.00	
	メキシコ・ペソ小計	197,000,000.00	181,863,530.00 (1,311,727,083)	
オフショア・人民元	CGB 1.85 05/15/27	11,000,000.00	11,089,870.00	
	CGB 1.91 07/15/29	5,500,000.00	5,537,840.00	
	CGB 1.99 03/15/26	35,000,000.00	35,308,350.00	

CGB 2.04	02/25/27	76,000,000.00	76,910,480.00		
CGB 2.05	04/15/29	25,000,000.00	25,330,500.00		
CGB 2.11	08/25/34	20,000,000.00	19,958,200.00		
CGB 2.18	08/15/26	22,800,000.00	23,095,260.00		
CGB 2.27	05/25/34	17,000,000.00	17,203,320.00		
CGB 2.28	03/25/31	28,000,000.00	28,525,560.00		
CGB 2.3	05/15/26	17,000,000.00	17,232,390.00		
CGB 2.35	02/25/34	22,000,000.00	22,404,140.00		
CGB 2.37	01/15/29	19,000,000.00	19,496,660.00		
CGB 2.39	11/15/26	72,000,000.00	73,324,080.00		
CGB 2.4	07/15/28	38,000,000.00	38,919,980.00		
CGB 2.46	02/15/26	29,000,000.00	29,388,310.00		
CGB 2.48	04/15/27	9,000,000.00	9,210,240.00		
CGB 2.5	07/25/27	11,000,000.00	11,288,090.00		
CGB 2.52	08/25/33	11,000,000.00	11,364,870.00		
CGB 2.54	12/25/30	27,000,000.00	27,946,080.00		
CGB 2.55	10/15/28	11,000,000.00	11,355,960.00		
CGB 2.6	09/15/30	32,000,000.00	33,251,200.00		
CGB 2.62	04/15/28	27,000,000.00	27,874,800.00		
CGB 2.62	06/25/30	22,000,000.00	22,865,480.00		
CGB 2.62	09/25/29	19,000,000.00	19,756,200.00		
CGB 2.64	01/15/28	31,500,000.00	32,399,325.00		
CGB 2.67	05/25/33	14,000,000.00	14,636,720.00		
CGB 2.67	11/25/33	15,000,000.00	15,691,350.00		
CGB 2.69	08/12/26	50,000,000.00	51,141,500.00		
CGB 2.8	03/24/29	22,000,000.00	22,999,240.00		
CGB 2.8	03/25/30	15,000,000.00	15,737,250.00		
CGB 2.8	11/15/32	21,000,000.00	22,180,410.00		
CGB 2.88	02/25/33	10,900,000.00	11,615,476.00		
CGB 2.91	10/14/28	21,000,000.00	21,975,450.00		
CGB 3	10/15/53	13,500,000.00	15,534,315.00		
CGB 3.02	05/27/31	32,400,000.00	34,626,528.00		
CGB 3.12	10/25/52	17,000,000.00	19,930,800.00		
CGB 3.19	04/15/53	13,000,000.00	15,441,400.00		
CGB 3.72	04/12/51	38,700,000.00	49,600,629.00		
オフショア・人民元小計		921,300,000.00	962,148,253.00 (19,378,627,964)		
マレーシ ア・リン ギット	MGS 3.502	05/31/27	5,100,000.00	5,120,808.00	
	MGS 3.582	07/15/32	2,500,000.00	2,473,175.00	
	MGS 3.757	05/22/40	1,400,000.00	1,367,212.00	
	MGS 3.9	11/30/26	1,300,000.00	1,317,901.00	
	MGS 3.955	09/15/25	3,200,000.00	3,225,440.00	
	MGS 4.498	04/15/30	4,000,000.00	4,180,760.00	
	MGS 4.504	04/30/29	700,000.00	730,527.00	

	MGS 4.696 10/15/42	2,200,000.00	2,395,470.00	
	MGS 4.736 03/15/46	6,700,000.00	7,325,512.00	
	マレーシア・リンギット小計	27,100,000.00	28,136,805.00 (924,175,870)	
ポーランド・ズロチ	POLGB 0 10/25/25	2,200,000.00	2,102,826.00	
	POLGB 0.25 10/25/26	7,900,000.00	7,204,326.00	
	POLGB 1.25 10/25/30	10,200,000.00	8,188,560.00	
	POLGB 2.75 04/25/28	4,000,000.00	3,726,000.00	
	POLGB 2.75 10/25/29	700,000.00	629,979.00	
	POLGB 6 10/25/33	2,800,000.00	2,957,864.00	
	POLGB 7.5 07/25/28	1,050,000.00	1,143,208.50	
	ポーランド・ズロチ小計	28,850,000.00	25,952,763.50 (960,945,188)	
ユーロ	BGB 0 10/22/27	650,000.00	605,462.00	
	BGB 0 10/22/31	1,500,000.00	1,255,455.00	
	BGB 0.1 06/22/30	700,000.00	612,619.00	
	BGB 0.35 06/22/32	1,200,000.00	1,011,096.00	
	BGB 0.4 06/22/40	800,000.00	532,176.00	
	BGB 0.65 06/22/71	400,000.00	175,080.00	
	BGB 0.8 06/22/27	800,000.00	768,080.00	
	BGB 0.8 06/22/28	700,000.00	662,613.00	
	BGB 0.9 06/22/29	900,000.00	841,320.00	
	BGB 1 06/22/26	700,000.00	683,473.00	
	BGB 1 06/22/31	1,100,000.00	997,964.00	
	BGB 1.25 04/22/33	900,000.00	807,174.00	
	BGB 1.45 06/22/37	1,000,000.00	841,920.00	
	BGB 1.6 06/22/47	650,000.00	479,394.50	
	BGB 1.7 06/22/50	1,100,000.00	799,062.00	
	BGB 1.9 06/22/38	700,000.00	613,158.00	
	BGB 2.15 06/22/66	500,000.00	380,075.00	
	BGB 2.25 06/22/57	500,000.00	392,685.00	
	BGB 2.85 10/22/34	200,000.00	201,374.00	
	BGB 3 06/22/34	200,000.00	204,784.00	
	BGB 3.45 06/22/43	500,000.00	518,160.00	
	BGB 3.75 06/22/45	600,000.00	647,592.00	
	BGB 4 03/28/32	300,000.00	328,722.00	
	BGB 4.25 03/28/41	680,000.00	778,144.40	
	BGB 4.5 03/28/26	650,000.00	670,124.00	
	BGB 5 03/28/35	1,000,000.00	1,197,200.00	
	BGB 5.5 03/28/28	1,000,000.00	1,107,610.00	
	BKO 2.5 03/19/26	2,100,000.00	2,104,557.00	
	BKO 3.1 09/18/25	300,000.00	301,362.00	
	BTPS 0 08/01/26	1,300,000.00	1,237,717.00	
	BTPS 0.45 02/15/29	2,400,000.00	2,164,296.00	

BTPS 0.5 02/01/26	1,500,000.00	1,454,970.00	
BTPS 0.85 01/15/27	900,000.00	864,783.00	
BTPS 0.9 04/01/31	2,000,000.00	1,739,140.00	
BTPS 0.95 03/01/37	1,000,000.00	727,350.00	
BTPS 0.95 06/01/32	3,300,000.00	2,788,071.00	
BTPS 0.95 08/01/30	1,200,000.00	1,065,276.00	
BTPS 0.95 09/15/27	800,000.00	761,280.00	
BTPS 0.95 12/01/31	900,000.00	771,165.00	
BTPS 1.1 04/01/27	1,500,000.00	1,444,470.00	
BTPS 1.25 12/01/26	800,000.00	777,272.00	
BTPS 1.35 04/01/30	1,900,000.00	1,741,749.00	
BTPS 1.45 03/01/36	400,000.00	318,660.00	
BTPS 1.6 06/01/26	1,200,000.00	1,179,780.00	
BTPS 1.65 12/01/30	1,100,000.00	1,010,361.00	
BTPS 1.7 09/01/51	1,500,000.00	937,500.00	
BTPS 2 02/01/28	1,500,000.00	1,467,345.00	
BTPS 2 12/01/25	1,300,000.00	1,288,638.00	
BTPS 2.05 08/01/27	1,300,000.00	1,279,395.00	
BTPS 2.1 07/15/26	1,000,000.00	991,100.00	
BTPS 2.2 06/01/27	900,000.00	890,505.00	
BTPS 2.25 09/01/36	500,000.00	432,230.00	
BTPS 2.45 09/01/33	600,000.00	557,964.00	
BTPS 2.45 09/01/50	1,700,000.00	1,263,474.00	
BTPS 2.5 11/15/25	200,000.00	199,456.00	
BTPS 2.65 12/01/27	400,000.00	399,920.00	
BTPS 2.7 03/01/47	950,000.00	766,374.50	
BTPS 2.8 03/01/67	700,000.00	524,125.00	
BTPS 2.8 06/15/29	1,000,000.00	995,800.00	
BTPS 2.8 12/01/28	1,300,000.00	1,301,612.00	
BTPS 2.95 02/15/27	2,000,000.00	2,014,060.00	
BTPS 2.95 09/01/38	1,000,000.00	907,060.00	
BTPS 3 08/01/29	2,000,000.00	2,010,360.00	
BTPS 3.1 03/01/40	700,000.00	635,313.00	
BTPS 3.25 03/01/38	800,000.00	753,016.00	
BTPS 3.25 09/01/46	1,100,000.00	976,811.00	
BTPS 3.35 03/01/35	700,000.00	687,330.00	
BTPS 3.35 07/01/29	600,000.00	611,382.00	
BTPS 3.45 03/01/48	1,000,000.00	909,380.00	
BTPS 3.45 07/15/31	170,000.00	172,589.10	
BTPS 3.5 02/15/31	1,000,000.00	1,020,170.00	
BTPS 3.5 03/01/30	1,000,000.00	1,027,890.00	
BTPS 3.7 06/15/30	1,900,000.00	1,963,061.00	
BTPS 3.85 02/01/35	800,000.00	818,056.00	
BTPS 3.85 07/01/34	1,000,000.00	1,027,420.00	

BTPS 3.85 09/01/49	1,100,000.00	1,058,288.00	
BTPS 3.85 09/15/26	2,900,000.00	2,967,454.00	
BTPS 3.85 12/15/29	1,300,000.00	1,355,484.00	
BTPS 4 02/01/37	2,000,000.00	2,069,340.00	
BTPS 4 04/30/35	500,000.00	520,390.00	
BTPS 4.1 02/01/29	1,500,000.00	1,575,930.00	
BTPS 4.4 05/01/33	3,000,000.00	3,233,970.00	
BTPS 4.5 03/01/26	1,300,000.00	1,333,423.00	
BTPS 4.75 09/01/28	1,800,000.00	1,932,084.00	
BTPS 4.75 09/01/44	1,200,000.00	1,316,460.00	
BTPS 5 08/01/34	1,570,000.00	1,766,250.00	
BTPS 5 08/01/39	1,800,000.00	2,024,082.00	
BTPS 5 09/01/40	1,700,000.00	1,909,423.00	
BTPS 5.75 02/01/33	1,700,000.00	1,995,086.00	
BTPS 6 05/01/31	1,200,000.00	1,407,444.00	
BTPS 6.5 11/01/27	1,700,000.00	1,897,115.00	
BTPS 7.25 11/01/26	400,000.00	438,460.00	
DBR 0 02/15/30	1,500,000.00	1,348,560.00	
DBR 0 02/15/32	2,700,000.00	2,326,752.00	
DBR 0 05/15/35	1,600,000.00	1,267,280.00	
DBR 0 05/15/36	800,000.00	615,784.00	
DBR 0 08/15/29	2,500,000.00	2,269,500.00	
DBR 0 08/15/30	2,500,000.00	2,225,600.00	
DBR 0 08/15/31	1,300,000.00	1,133,379.00	
DBR 0 08/15/31	1,700,000.00	1,482,944.00	
DBR 0 08/15/50	2,000,000.00	1,079,180.00	
DBR 0 08/15/50	2,100,000.00	1,135,176.00	
DBR 0 11/15/27	1,000,000.00	938,400.00	
DBR 0 11/15/28	500,000.00	460,855.00	
DBR 0.25 02/15/27	300,000.00	287,301.00	
DBR 0.25 02/15/29	1,200,000.00	1,113,360.00	
DBR 0.25 08/15/28	1,500,000.00	1,403,655.00	
DBR 0.5 02/15/26	3,200,000.00	3,119,040.00	
DBR 0.5 02/15/28	1,600,000.00	1,522,464.00	
DBR 0.5 08/15/27	2,100,000.00	2,011,569.00	
DBR 1 05/15/38	1,600,000.00	1,348,688.00	
DBR 1.25 08/15/48	1,650,000.00	1,297,362.00	
DBR 1.7 08/15/32	2,400,000.00	2,339,928.00	
DBR 1.8 08/15/53	1,200,000.00	1,044,924.00	
DBR 1.8 08/15/53	1,000,000.00	872,400.00	
DBR 2.1 11/15/29	1,400,000.00	1,404,382.00	
DBR 2.2 02/15/34	100,000.00	100,518.00	
DBR 2.3 02/15/33	1,600,000.00	1,626,720.00	
DBR 2.3 02/15/33	1,300,000.00	1,322,100.00	

DBR 2.4 11/15/30	1,100,000.00	1,121,769.00	
DBR 2.5 07/04/44	1,600,000.00	1,610,576.00	
DBR 2.5 08/15/46	1,500,000.00	1,510,545.00	
DBR 2.5 08/15/54	500,000.00	507,150.00	
DBR 2.6 08/15/33	900,000.00	935,946.00	
DBR 2.6 08/15/34	450,000.00	467,176.50	
DBR 3.25 07/04/42	800,000.00	892,704.00	
DBR 4 01/04/37	1,300,000.00	1,534,728.00	
DBR 4.25 07/04/39	700,000.00	860,671.00	
DBR 4.75 07/04/28	1,600,000.00	1,758,768.00	
DBR 4.75 07/04/34	600,000.00	736,674.00	
DBR 4.75 07/04/40	1,450,000.00	1,892,757.50	
DBR 5.5 01/04/31	900,000.00	1,081,602.00	
DBR 5.625 01/04/28	1,000,000.00	1,113,930.00	
DBR 6.25 01/04/30	500,000.00	604,775.00	
DBR 6.5 07/04/27	1,000,000.00	1,119,270.00	
FRTR 0 02/25/26	2,000,000.00	1,928,720.00	
FRTR 0 02/25/27	1,100,000.00	1,037,289.00	
FRTR 0 05/25/32	2,900,000.00	2,368,720.00	
FRTR 0 11/25/29	2,500,000.00	2,198,525.00	
FRTR 0 11/25/30	4,100,000.00	3,506,443.00	
FRTR 0 11/25/31	3,000,000.00	2,489,850.00	
FRTR 0.25 11/25/26	2,900,000.00	2,766,107.00	
FRTR 0.5 05/25/26	3,100,000.00	2,999,994.00	
FRTR 0.5 05/25/29	3,000,000.00	2,737,470.00	
FRTR 0.5 05/25/40	1,300,000.00	875,849.00	
FRTR 0.5 05/25/72	500,000.00	190,445.00	
FRTR 0.5 06/25/44	350,000.00	211,893.50	
FRTR 0.75 02/25/28	4,200,000.00	3,968,622.00	
FRTR 0.75 05/25/28	2,500,000.00	2,352,750.00	
FRTR 0.75 05/25/52	3,000,000.00	1,615,800.00	
FRTR 0.75 11/25/28	3,400,000.00	3,170,840.00	
FRTR 1 05/25/27	2,000,000.00	1,926,900.00	
FRTR 1 11/25/25	800,000.00	784,696.00	
FRTR 1.25 05/25/34	1,500,000.00	1,301,055.00	
FRTR 1.25 05/25/36	1,850,000.00	1,538,793.00	
FRTR 1.25 05/25/38	900,000.00	715,689.00	
FRTR 1.5 05/25/31	2,650,000.00	2,476,054.00	
FRTR 1.5 05/25/50	2,400,000.00	1,648,104.00	
FRTR 1.75 05/25/66	800,000.00	523,464.00	
FRTR 1.75 06/25/39	2,000,000.00	1,684,540.00	
FRTR 2 05/25/48	2,000,000.00	1,572,080.00	
FRTR 2 11/25/32	2,700,000.00	2,559,789.00	
FRTR 2.5 05/25/30	2,100,000.00	2,096,850.00	



FRTR 2.5 05/25/43	1,100,000.00	983,851.00	
FRTR 2.5 09/24/26	3,100,000.00	3,103,720.00	
FRTR 2.5 09/24/27	1,100,000.00	1,102,211.00	
FRTR 2.75 02/25/29	1,600,000.00	1,616,976.00	
FRTR 2.75 02/25/30	600,000.00	605,826.00	
FRTR 2.75 10/25/27	2,650,000.00	2,675,731.50	
FRTR 3 05/25/33	2,200,000.00	2,240,942.00	
FRTR 3 05/25/54	1,300,000.00	1,199,562.00	
FRTR 3 11/25/34	500,000.00	505,130.00	
FRTR 3.25 05/25/45	900,000.00	897,759.00	
FRTR 3.5 04/25/26	1,800,000.00	1,828,134.00	
FRTR 3.5 11/25/33	3,400,000.00	3,591,794.00	
FRTR 4 04/25/55	1,370,000.00	1,518,905.30	
FRTR 4 04/25/60	1,400,000.00	1,569,330.00	
FRTR 4 10/25/38	2,000,000.00	2,208,240.00	
FRTR 4.5 04/25/41	1,900,000.00	2,222,848.00	
FRTR 4.75 04/25/35	800,000.00	934,624.00	
FRTR 5.5 04/25/29	1,650,000.00	1,862,223.00	
FRTR 5.75 10/25/32	400,000.00	487,540.00	
FRTR 6 10/25/25	1,700,000.00	1,761,591.00	
IRISH 0 10/18/31	500,000.00	423,215.00	
IRISH 0.9 05/15/28	500,000.00	476,900.00	
IRISH 1 05/15/26	1,000,000.00	977,400.00	
IRISH 1.1 05/15/29	500,000.00	474,155.00	
IRISH 1.3 05/15/33	250,000.00	227,837.50	
IRISH 1.35 03/18/31	500,000.00	470,270.00	
IRISH 1.5 05/15/50	500,000.00	375,485.00	
IRISH 1.7 05/15/37	300,000.00	267,291.00	
IRISH 2 02/18/45	1,100,000.00	952,391.00	
IRISH 2.4 05/15/30	600,000.00	602,610.00	
IRISH 2.6 10/18/34	300,000.00	300,717.00	
NETHER 0 01/15/27	1,300,000.00	1,236,586.00	
NETHER 0 07/15/30	1,700,000.00	1,492,923.00	
NETHER 0.25 07/15/29	500,000.00	455,545.00	
NETHER 0.5 01/15/40	1,500,000.00	1,100,400.00	
NETHER 0.5 07/15/26	1,300,000.00	1,259,791.00	
NETHER 0.5 07/15/32	1,200,000.00	1,044,396.00	
NETHER 0.75 07/15/27	400,000.00	384,704.00	
NETHER 0.75 07/15/28	1,700,000.00	1,611,243.00	
NETHER 2 01/15/54	200,000.00	173,880.00	
NETHER 2.5 01/15/33	600,000.00	606,078.00	
NETHER 2.5 07/15/33	800,000.00	806,320.00	
NETHER 2.75 01/15/47	2,300,000.00	2,341,975.00	
NETHER 3.25 01/15/44	200,000.00	217,318.00	

NETHER 3.75 01/15/42	1,300,000.00	1,494,766.00	
NETHER 4 01/15/37	300,000.00	344,799.00	
NETHER 5.5 01/15/28	700,000.00	773,857.00	
OBL 0 04/10/26	2,100,000.00	2,027,319.00	
OBL 0 04/16/27	2,200,000.00	2,086,370.00	
OBL 0 10/09/26	2,700,000.00	2,583,738.00	
OBL 1.3 10/15/27	300,000.00	293,694.00	
OBL 2.1 04/12/29	1,000,000.00	1,002,640.00	
OBL 2.1 04/12/29	600,000.00	601,776.00	
OBL 2.2 04/13/28	600,000.00	603,480.00	
OBL 2.4 10/19/28	1,600,000.00	1,622,416.00	
RAGB 0 02/20/30	800,000.00	701,936.00	
RAGB 0 02/20/31	1,400,000.00	1,193,864.00	
RAGB 0 10/20/40	300,000.00	188,031.00	
RAGB 0.5 02/20/29	550,000.00	507,551.00	
RAGB 0.5 04/20/27	700,000.00	668,920.00	
RAGB 0.75 02/20/28	600,000.00	569,454.00	
RAGB 0.75 03/20/51	900,000.00	539,874.00	
RAGB 0.75 10/20/26	600,000.00	580,908.00	
RAGB 0.85 06/30/20	250,000.00	117,437.50	
RAGB 0.9 02/20/32	600,000.00	533,862.00	
RAGB 1.2 10/20/25	1,000,000.00	985,000.00	
RAGB 1.5 02/20/47	700,000.00	530,831.00	
RAGB 1.5 11/02/86	200,000.00	125,436.00	
RAGB 2.4 05/23/34	1,000,000.00	977,560.00	
RAGB 2.9 02/20/33	500,000.00	510,230.00	
RAGB 2.9 02/20/34	300,000.00	305,655.00	
RAGB 3.15 06/20/44	500,000.00	511,665.00	
RAGB 3.15 10/20/53	150,000.00	153,264.00	
RAGB 3.2 07/15/39	200,000.00	206,728.00	
RAGB 3.8 01/26/62	700,000.00	825,958.00	
RAGB 4.15 03/15/37	300,000.00	341,223.00	
RAGB 4.85 03/15/26	800,000.00	827,280.00	
RAGB 6.25 07/15/27	1,000,000.00	1,107,580.00	
RFGB 0 09/15/26	300,000.00	286,293.00	
RFGB 0 09/15/30	400,000.00	345,956.00	
RFGB 0.25 09/15/40	700,000.00	462,420.00	
RFGB 0.5 04/15/26	700,000.00	679,595.00	
RFGB 0.5 09/15/27	700,000.00	664,475.00	
RFGB 0.5 09/15/28	300,000.00	279,300.00	
RFGB 0.5 09/15/29	100,000.00	91,135.00	
RFGB 0.75 04/15/31	800,000.00	716,672.00	
RFGB 1.375 04/15/47	500,000.00	372,175.00	
RFGB 2.625 07/04/42	800,000.00	765,520.00	

RFGB 2.75 04/15/38	200,000.00	196,884.00	
RFGB 2.75 07/04/28	200,000.00	203,262.00	
RFGB 3 09/15/33	800,000.00	823,536.00	
SPGB 0 01/31/27	500,000.00	471,810.00	
SPGB 0.1 04/30/31	800,000.00	677,584.00	
SPGB 0.5 04/30/30	1,600,000.00	1,429,328.00	
SPGB 0.5 10/31/31	1,400,000.00	1,203,552.00	
SPGB 0.7 04/30/32	1,400,000.00	1,206,548.00	
SPGB 0.8 07/30/27	1,100,000.00	1,050,643.00	
SPGB 0.8 07/30/29	700,000.00	644,861.00	
SPGB 0.85 07/30/37	500,000.00	376,400.00	
SPGB 1 10/31/50	800,000.00	457,160.00	
SPGB 1.2 10/31/40	1,400,000.00	1,022,784.00	
SPGB 1.25 10/31/30	3,000,000.00	2,770,560.00	
SPGB 1.3 10/31/26	1,400,000.00	1,367,366.00	
SPGB 1.4 04/30/28	1,500,000.00	1,446,495.00	
SPGB 1.4 07/30/28	1,200,000.00	1,153,968.00	
SPGB 1.45 04/30/29	2,100,000.00	2,005,185.00	
SPGB 1.45 10/31/27	1,300,000.00	1,262,235.00	
SPGB 1.45 10/31/71	400,000.00	206,356.00	
SPGB 1.5 04/30/27	1,500,000.00	1,465,125.00	
SPGB 1.85 07/30/35	600,000.00	535,062.00	
SPGB 1.95 04/30/26	2,300,000.00	2,279,714.00	
SPGB 1.95 07/30/30	700,000.00	676,417.00	
SPGB 2.15 10/31/25	1,600,000.00	1,590,176.00	
SPGB 2.35 07/30/33	700,000.00	672,553.00	
SPGB 2.5 05/31/27	1,400,000.00	1,401,456.00	
SPGB 2.55 10/31/32	1,600,000.00	1,572,800.00	
SPGB 2.7 10/31/48	750,000.00	648,180.00	
SPGB 2.8 05/31/26	1,100,000.00	1,104,609.00	
SPGB 2.9 10/31/46	1,700,000.00	1,541,543.00	
SPGB 3.15 04/30/33	1,900,000.00	1,944,441.00	
SPGB 3.45 07/30/43	700,000.00	694,995.00	
SPGB 3.45 07/30/66	1,300,000.00	1,231,217.00	
SPGB 3.45 10/31/34	600,000.00	623,574.00	
SPGB 3.55 10/31/33	1,800,000.00	1,892,880.00	
SPGB 3.9 07/30/39	700,000.00	745,871.00	
SPGB 4.2 01/31/37	1,050,000.00	1,163,421.00	
SPGB 4.7 07/30/41	1,100,000.00	1,284,041.00	
SPGB 4.9 07/30/40	1,400,000.00	1,660,512.00	
SPGB 5.15 10/31/28	1,500,000.00	1,656,495.00	
SPGB 5.15 10/31/44	1,400,000.00	1,735,342.00	
SPGB 5.75 07/30/32	1,000,000.00	1,211,000.00	
SPGB 5.9 07/30/26	500,000.00	530,940.00	

	SPGB 6 01/31/29	1,900,000.00	2,176,735.00	
	ユーロ小計	358,690,000.00	340,609,617.80 (53,928,720,786)	
	国債証券合計		178,490,108,683 (178,490,108,683)	
	合 計		178,490,108,683 (178,490,108,683)	

(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	46.2%	46.8%
カナダ・ドル	国債証券 27銘柄	2.0%	2.0%
オーストラリア・ドル	国債証券 23銘柄	1.3%	1.3%
シンガポール・ドル	国債証券 13銘柄	0.4%	0.4%
ニュージーランド・ドル	国債証券 9銘柄	0.3%	0.3%
イギリス・ポンド	国債証券 56銘柄	5.4%	5.5%
イスラエル・シケル	国債証券 10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 8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	0.7%	0.7%
オフショア・人民元	国債証券 38銘柄	10.7%	10.9%
マレーシア・リングギット	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	0.5%	0.5%
ユーロ	国債証券 296銘柄	29.8%	30.2%

#### 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。

#### 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9月10日現在）

資産の部	
流動資産	
金銭信託	20,504,480
コール・ローン	3,810,175,329
株式	317,631,995,360
派生商品評価勘定	1,586,700
未収入金	21,117,600
未収配当金	154,915,019
前払金	64,265,000
差入委託証拠金	357,797,205
流動資産合計	322,062,356,693
資産合計	322,062,356,693
負債の部	
流動負債	

派生商品評価勘定	34,969,800
未払金	71,661,200
未払解約金	132,920,430
流動負債合計	239,551,430
負債合計	239,551,430
純資産の部	
元本等	
元本	69,995,003,999
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	251,827,801,264
元本等合計	321,822,805,263
純資産合計	321,822,805,263
負債純資産合計	322,062,356,693

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年9月12日 至 2024年9月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、新株予約権証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2024年9月10日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	69,995,003,999口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 4.5978円 (1万口当たりの純資産額45,978円)

## (金融商品に関する注記)

## ・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年9月12日 至 2024年9月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券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。

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2024年9月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2024年9月10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 0612月	4,396,448,100	-	4,363,065,000	33,383,100
	小計	4,396,448,100	-	4,363,065,000	33,383,100
合計		4,396,448,100	-	4,363,065,000	33,383,100

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

自 2023年9月12日 至 2024年9月10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9月10日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	67,733,425,616円
同期中における追加設定元本額	11,701,843,453円
同期中における一部解約元本額	9,440,265,070円
2024年9月10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	9,715,954,275円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	937,124,798円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,195,672,960円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,628,211,613円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	133,565,886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)	3,036,423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)	11,977,031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)	42,887,777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)	124,903,411円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	123,576,568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)	253,304,691円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,538,836,106円
三井住友・DCつみたてN I S A・日本株インデックスファンド	29,279,650,997円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	105,178,908円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	151,619,140円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	92,399,058円



三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	68,565,605円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	216,395,313円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	216,217,470円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	895,059,354円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	538,451,145円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	673,259,861円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	65,310,389円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	1,481,313,054円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	41,988,333円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	254,370,464円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	291,224,732円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	9,337,916円
日興FWS・日本株インデックス	2,791,404,735円
三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド	225,713,429円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	21,668,463円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	13,571,815円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	14,418,418円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	7,555,104円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	4,628,843円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	875,783円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	22,523,918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)	113,782,264円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	119,212,016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)	45,271,437円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	1,950,087,465円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	6,594,375円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	33,548,131円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	693,300,718円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	977,324,801円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	3,839,603,508円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	23,860,855円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	91,834,407円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	561,545,046円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	29,035,936円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	155,287,022円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	543,730,636円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	344,922,224円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	1,024,338,247円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	22,216,667円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	23,652,147円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	17,960,373円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	13,108,995円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	53,627,629円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	143,857,608円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	28,624,594円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	28,385,337円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	6,486,356円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	24,746,633円

SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	324,341,423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)	147,118,926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>	132,037,002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>	53,003,126円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	37,593,666円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	24,166,736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>	25,219,091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>	15,386,731円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	24,463,796円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	23,379,285円
SMDAM・日米3資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	10,117,443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>	70,477,561円
合計	69,995,003,999円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

(単位:円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	4,500	4,190.000	18,855,000	
ニッセイ	121,800	940.400	114,540,720	
マルハニチロ	18,000	3,094.000	55,692,000	
雪国まいたけ	12,000	998.000	11,976,000	
カネコ種苗	4,800	1,362.000	6,537,600	
サカタのタネ	13,600	3,420.000	46,512,000	
ホクト	10,100	1,809.000	18,270,900	
住石ホールディングス	15,900	946.000	15,041,400	
日鉄鉱業	4,800	4,120.000	19,776,000	
三井松島ホールディングス	7,500	4,565.000	34,237,500	
INPEX	370,800	1,923.000	713,048,400	
石油資源開発	13,800	5,270.000	72,726,000	
K&Oエナジーグループ	5,800	3,265.000	18,937,000	
ショーボンドホールディングス	16,400	5,629.000	92,315,600	
ミライト・ワン	39,000	2,040.500	79,579,500	
タマホーム	7,900	3,930.000	31,047,000	
日本アクア	3,300	846.000	2,791,800	
安藤・間	68,700	1,124.000	77,218,800	
東急建設	36,300	725.000	26,317,500	
コムシスホールディングス	38,200	3,212.000	122,698,400	
ビーアールホールディングス	18,500	357.000	6,604,500	
高松コンストラクショングループ	8,800	2,933.000	25,810,400	
東建コーポレーション	3,200	10,830.000	34,656,000	
ヤマウラ	6,300	1,122.000	7,068,600	

オリエンタル白石	44,000	383.000	16,852,000
大成建設	78,700	6,451.000	507,693,700
大林組	307,300	1,856.500	570,502,450
清水建設	244,000	1,004.500	245,098,000
飛島建設	9,400	1,416.000	13,310,400
長谷工コーポレーション	78,700	1,872.000	147,326,400
松井建設	9,700	757.000	7,342,900
銭高組	1,500	3,480.000	5,220,000
鹿島建設	190,000	2,610.000	495,900,000
不動テトラ	5,800	2,291.000	13,287,800
鉄建建設	6,700	2,386.000	15,986,200
西松建設	16,300	5,239.000	85,395,700
三井住友建設	65,600	383.000	25,124,800
大豊建設	3,800	3,420.000	12,996,000
奥村組	13,400	4,400.000	58,960,000
東鉄工業	10,900	3,420.000	37,278,000
浅沼組	31,000	694.000	21,514,000
戸田建設	116,800	993.500	116,040,800
熊谷組	14,100	3,460.000	48,786,000
北野建設	1,900	3,800.000	7,220,000
矢作建設工業	11,500	1,614.000	18,561,000
ピーエス・コンストラクション	10,900	977.000	10,649,300
日本ハウスホールディングス	19,500	357.000	6,961,500
新日本建設	11,500	1,592.000	18,308,000
東亜道路工業	17,000	1,324.000	22,508,000
日本道路	9,900	1,663.000	16,463,700
東亜建設工業	26,800	912.000	24,441,600
日本国土開発	24,300	487.000	11,834,100
若築建設	3,200	3,305.000	10,576,000
東洋建設	22,400	1,355.000	30,352,000
五洋建設	119,400	612.000	73,072,800
世紀東急工業	10,800	1,595.000	17,226,000
福田組	3,100	5,270.000	16,337,000
住友林業	74,500	6,202.000	462,049,000
巴コーポレーション	11,300	958.000	10,825,400
大和ハウス工業	237,300	4,561.000	1,082,325,300
ライト工業	16,100	2,152.000	34,647,200
積水ハウス	260,000	3,826.000	994,760,000
日特建設	6,800	1,003.000	6,820,400
北陸電気工事	5,600	1,185.000	6,636,000
ユアテック	19,100	1,516.000	28,955,600
日本リーテック	7,700	1,072.000	8,254,400
四電工	3,500	3,860.000	13,510,000
中電工	13,000	3,235.000	42,055,000
関電工	53,300	2,265.000	120,724,500
きんでん	59,700	3,385.000	202,084,500
東京エネシス	8,700	1,115.000	9,700,500
トーエネック	2,900	4,855.000	14,079,500

住友電設	8,100	3,650.000	29,565,000
日本電設工業	14,700	1,774.000	26,077,800
エクシオグループ	82,100	1,597.000	131,113,700
新日本空調	5,500	3,410.000	18,755,000
九電工	18,600	6,552.000	121,867,200
三機工業	17,600	2,209.000	38,878,400
日揮ホールディングス	84,900	1,196.500	101,582,850
中外炉工業	3,000	2,635.000	7,905,000
ヤマト	7,000	966.000	6,762,000
太平電業	5,500	5,350.000	29,425,000
高砂熱学工業	22,900	5,110.000	117,019,000
三晃金属工業	1,200	4,035.000	4,842,000
朝日工業社	8,000	1,295.000	10,360,000
明星工業	16,400	1,177.000	19,302,800
大気社	9,600	4,760.000	45,696,000
ダイダン	11,200	2,875.000	32,200,000
日比谷総合設備	6,400	3,330.000	21,312,000
テスホールディングス	19,300	280.000	5,404,000
インフロニア・ホールディングス	99,200	1,190.000	118,048,000
東洋エンジニアリング	12,300	675.000	8,302,500
レイズネクスト	12,800	1,615.000	20,672,000
ニッポン	24,500	2,256.000	55,272,000
日清製粉グループ本社	79,700	1,938.000	154,458,600
日東富士製粉	1,700	7,080.000	12,036,000
昭和産業	7,200	2,912.000	20,966,400
鳥越製粉	10,700	675.000	7,222,500
中部飼料	12,100	1,518.000	18,367,800
フィード・ワン	12,900	826.000	10,655,400
日本甜菜製糖	5,200	2,727.000	14,180,400
DM三井製糖ホールディングス	8,300	3,310.000	27,473,000
ウェルネオシュガー	4,700	2,190.000	10,293,000
森永製菓	35,700	2,959.500	105,654,150
中村屋	3,100	3,210.000	9,951,000
江崎グリコ	24,600	4,287.000	105,460,200
井村屋グループ	4,600	2,492.000	11,463,200
不二家	5,700	2,647.000	15,087,900
山崎製パン	58,000	2,906.500	168,577,000
モロゾフ	2,600	4,670.000	12,142,000
亀田製菓	5,100	4,695.000	23,944,500
寿スピリッツ	40,800	1,759.500	71,787,600
カルビー	39,700	3,511.000	139,386,700
森永乳業	30,100	3,555.000	107,005,500
六甲バター	6,300	1,444.000	9,097,200
ヤクルト本社	123,400	3,116.000	384,514,400
明治ホールディングス	105,500	3,717.000	392,143,500
雪印メグミルク	20,900	2,710.000	56,639,000
プリマハム	10,700	2,426.000	25,958,200
日本ハム	37,000	5,565.000	205,905,000

丸大食品	8,400	1,726.000	14,498,400
S Foods	9,400	2,699.000	25,370,600
柿安本店	3,100	2,591.000	8,032,100
伊藤ハム米久ホールディングス	12,700	3,915.000	49,720,500
サッポロホールディングス	28,500	7,716.000	219,906,000
アサヒグループホールディングス	215,900	5,581.000	1,204,937,900
キリンホールディングス	359,000	2,239.000	803,801,000
宝ホールディングス	57,100	1,159.500	66,207,450
オエノンホールディングス	28,500	392.000	11,172,000
養命酒製造	2,800	2,283.000	6,392,400
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	62,500	2,192.500	137,031,250
ライフドリンク カンパニー	2,100	7,350.000	15,435,000
サントリー食品インターナショナル	60,800	5,542.000	336,953,600
ダイドーグループホールディングス	9,400	3,000.000	28,200,000
伊藤園	29,000	3,354.000	97,266,000
キーコーヒー	9,800	2,055.000	20,139,000
日清オイリオグループ	11,600	5,300.000	61,480,000
不二製油グループ本社	20,400	3,439.000	70,155,600
かどや製油	1,800	3,630.000	6,534,000
J - オイルミルズ	8,500	1,957.000	16,634,500
キッコーマン	285,500	1,633.500	466,364,250
味の素	202,000	5,456.000	1,102,112,000
ブルドックソース	4,700	1,803.000	8,474,100
キューピー	46,700	3,721.000	173,770,700
ハウス食品グループ本社	28,600	2,998.000	85,742,800
カゴメ	36,900	3,178.000	117,268,200
アリアケジャパン	8,800	4,825.000	42,460,000
エバラ食品工業	2,800	2,789.000	7,809,200
やまみ	900	4,975.000	4,477,500
ニチレイ	39,500	4,490.000	177,355,000
東洋水産	43,600	9,273.000	404,302,800
イトアンドホールディングス	4,100	2,047.000	8,392,700
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,000	1,709.000	8,545,000
日清食品ホールディングス	91,000	3,891.000	354,081,000
フジッコ	7,600	1,719.000	13,064,400
ロック・フィールド	9,200	1,464.000	13,468,800
日本たばこ産業	524,100	4,207.000	2,204,888,700
ケンコーマヨネーズ	6,300	2,245.000	14,143,500
わらべや日洋ホールディングス	6,200	2,354.000	14,594,800
なとり	4,600	2,071.000	9,526,600
ファーマフーズ	12,200	950.000	11,590,000
ユーグレナ	55,500	481.000	26,695,500
紀文食品	7,100	1,188.000	8,434,800
ピククルスホールディングス	5,200	1,011.000	5,257,200
ミヨシ油脂	5,200	1,550.000	8,060,000
理研ビタミン	7,200	2,590.000	18,648,000
片倉工業	9,000	1,967.000	17,703,000

グンゼ	8,000	5,620.000	44,960,000
東洋紡	47,000	975.000	45,825,000
ユニチカ	30,500	290.000	8,845,000
富士紡ホールディングス	3,600	4,225.000	15,210,000
倉敷紡績	8,000	4,640.000	37,120,000
シキボウ	5,700	1,035.000	5,899,500
日本毛織	27,800	1,292.000	35,917,600
ダイドーリミテッド	2,700	921.000	2,486,700
帝国繊維	12,300	2,694.000	33,136,200
帝人	83,300	1,352.500	112,663,250
東レ	585,200	746.300	436,734,760
ダイニック	3,300	767.000	2,531,100
セーレン	16,000	2,503.000	40,048,000
小松マテーレ	13,300	751.000	9,988,300
ワコールホールディングス	17,700	4,358.000	77,136,600
ホギメディカル	11,300	4,370.000	49,381,000
T S Iホールディングス	28,800	896.000	25,804,800
ワールド	17,000	1,918.000	32,606,000
三陽商会	5,700	2,361.000	13,457,700
オンワードホールディングス	54,600	536.000	29,265,600
ルックホールディングス	3,700	2,596.000	9,605,200
ゴールドウイン	15,500	7,960.000	123,380,000
特種東海製紙	4,400	3,700.000	16,280,000
王子ホールディングス	363,800	574.900	209,148,620
日本製紙	49,600	906.000	44,937,600
北越コーポレーション	44,900	1,435.000	64,431,500
大王製紙	40,200	861.900	34,648,380
レンゴー	80,000	997.000	79,760,000
トーモク	5,400	2,366.000	12,776,400
ザ・バック	6,700	3,685.000	24,689,500
北の達人コーポレーション	41,500	167.000	6,930,500
クラレ	126,800	1,837.500	232,995,000
旭化成	593,300	1,029.000	610,505,700
レゾナック・ホールディングス	80,500	3,080.000	247,940,000
住友化学	650,400	390.600	254,046,240
住友精化	5,400	5,220.000	28,188,000
日産化学	41,500	4,935.000	204,802,500
ラサ工業	3,400	2,490.000	8,466,000
クレハ	19,600	2,676.000	52,449,600
多木化学	3,400	3,845.000	13,073,000
テイカ	7,400	1,637.000	12,113,800
石原産業	14,800	1,463.000	21,652,400
日本曹達	10,100	4,940.000	49,894,000
東ソー	119,000	1,851.500	220,328,500
トクヤマ	29,000	2,587.500	75,037,500
セントラル硝子	9,900	3,395.000	33,610,500
東亜合成	41,100	1,589.500	65,328,450
大阪ソーダ	6,200	8,860.000	54,932,000

関東電化工業	16,800	899.000	15,103,200
デンカ	34,800	2,183.000	75,968,400
信越化学工業	786,700	5,573.000	4,384,279,100
日本カーバイド工業	3,800	1,669.000	6,342,200
堺化学工業	6,300	2,562.000	16,140,600
第一稀元素化学工業	8,000	809.000	6,472,000
エア・ウォーター	81,900	2,002.500	164,004,750
日本酸素ホールディングス	85,300	5,083.000	433,579,900
日本化学工業	3,000	2,695.000	8,085,000
日本パーカラライジング	39,000	1,200.000	46,800,000
高压ガス工業	12,600	884.000	11,138,400
四国化成ホールディングス	11,000	1,936.000	21,296,000
ステラ ケミファ	4,800	4,035.000	19,368,000
保土谷化学工業	2,700	4,670.000	12,609,000
日本触媒	50,400	1,669.000	84,117,600
大日精化工業	5,800	2,967.000	17,208,600
カネカ	23,400	3,718.000	87,001,200
三菱瓦斯化学	63,300	2,582.500	163,472,250
三井化学	72,200	3,792.000	273,782,400
東京応化工業	42,000	3,153.000	132,426,000
大阪有機化学工業	7,700	2,865.000	22,060,500
三菱ケミカルグループ	640,700	900.000	576,630,000
K Hネオケム	13,300	2,017.000	26,826,100
ダイセル	110,600	1,269.500	140,406,700
住友ベークライト	24,400	3,694.000	90,133,600
積水化学工業	174,000	2,226.000	387,324,000
日本ゼオン	60,200	1,276.500	76,845,300
アイカ工業	22,000	3,326.000	73,172,000
U B E	41,900	2,541.000	106,467,900
積水樹脂	13,300	2,288.000	30,430,400
旭有機材	5,900	3,860.000	22,774,000
ニチバン	5,100	1,939.000	9,888,900
リケンテクノス	18,200	972.000	17,690,400
大倉工業	4,000	2,543.000	10,172,000
積水化成成品工業	8,700	401.000	3,488,700
群栄化学工業	2,100	2,700.000	5,670,000
ミライアル	2,700	1,338.000	3,612,600
ダイキョーニシカワ	18,600	651.000	12,108,600
森六ホールディングス	4,400	2,240.000	9,856,000
恵和	6,300	1,039.000	6,545,700
日本化薬	69,000	1,277.000	88,113,000
カーリット	8,700	1,044.000	9,082,800
日本精化	6,000	2,245.000	13,470,000
扶桑化学工業	9,400	3,670.000	34,498,000
トリケミカル研究所	10,800	3,140.000	33,912,000
A D E K A	30,000	2,898.000	86,940,000
日油	81,000	2,206.500	178,726,500
ハリマ化成グループ	5,800	850.000	4,930,000

花王	213,800	7,017.000	1,500,234,600
第一工業製薬	3,600	2,925.000	10,530,000
石原ケミカル	4,000	2,196.000	8,784,000
三洋化成工業	5,800	4,080.000	23,664,000
大日本塗料	9,700	1,091.000	10,582,700
日本ペイントホールディングス	393,800	870.600	342,842,280
関西ペイント	78,000	2,708.000	211,224,000
中国塗料	18,200	1,970.000	35,854,000
日本特殊塗料	5,200	1,195.000	6,214,000
藤倉化成	13,700	464.000	6,356,800
太陽ホールディングス	15,300	3,565.000	54,544,500
D I C	33,200	3,128.000	103,849,600
サカタインクス	21,500	1,557.000	33,475,500
a r t i e n c e	18,500	3,795.000	70,207,500
富士フィルムホールディングス	488,900	3,810.000	1,862,709,000
資生堂	183,800	3,199.000	587,976,200
ライオン	112,300	1,547.500	173,784,250
高砂香料工業	6,800	4,970.000	33,796,000
マンダム	21,300	1,229.000	26,177,700
ミルボン	14,200	3,002.000	42,628,400
コーセー	18,000	8,084.000	145,512,000
コタ	8,600	1,618.000	13,914,800
ポーラ・オルビスホールディングス	47,200	1,424.000	67,212,800
ノエビアホールディングス	8,200	5,420.000	44,444,000
新日本製薬	5,000	1,811.000	9,055,000
I - n e	3,200	1,825.000	5,840,000
アクシージア	6,300	729.000	4,592,700
エステー	6,700	1,517.000	10,163,900
アグロ カネショウ	4,400	1,298.000	5,711,200
コニシ	25,100	1,249.000	31,349,900
長谷川香料	18,400	2,945.000	54,188,000
小林製薬	23,800	5,545.000	131,971,000
荒川化学工業	7,700	1,211.000	9,324,700
メック	7,600	3,450.000	26,220,000
日本高純度化学	2,300	3,095.000	7,118,500
タカラバイオ	25,600	988.000	25,292,800
J C U	9,700	3,360.000	32,592,000
新田ゼラチン	6,000	899.000	5,394,000
O A T アグリオ	3,300	1,955.000	6,451,500
デクセリアルズ	21,700	5,837.000	126,662,900
アース製薬	8,500	5,310.000	45,135,000
北興化学工業	9,600	1,259.000	12,086,400
大成ラミック	3,500	2,685.000	9,397,500
クミアイ化学工業	34,600	795.000	27,507,000
日本農薬	16,300	591.000	9,633,300
アキレス	5,700	1,527.000	8,703,900
有沢製作所	15,900	1,456.000	23,150,400
日東電工	55,500	11,155.000	619,102,500



レック	12,300	1,217.000	14,969,100
三光合成	11,700	539.000	6,306,300
きもと	21,600	242.000	5,227,200
藤森工業	6,900	4,360.000	30,084,000
前澤化成工業	6,000	1,759.000	10,554,000
未来工業	3,300	3,365.000	11,104,500
J S P	6,000	1,922.000	11,532,000
エフピコ	17,200	2,874.500	49,441,400
天馬	6,100	2,511.000	15,317,100
信越ポリマー	19,000	1,503.000	28,557,000
東リ	18,200	370.000	6,734,000
ニフコ	26,000	3,575.000	92,950,000
バルカー	7,500	3,355.000	25,162,500
ユニ・チャーム	183,400	5,056.000	927,270,400
協和キリン	106,200	3,198.000	339,627,600
武田薬品工業	777,400	4,267.000	3,317,165,800
アステラス製薬	770,300	1,791.000	1,379,607,300
塩野義製薬	106,800	6,475.000	691,530,000
わかもと製薬	9,000	244.000	2,196,000
日本新薬	23,000	3,436.000	79,028,000
中外製薬	275,100	6,584.000	1,811,258,400
科研製薬	14,400	4,034.000	58,089,600
エーザイ	107,000	5,718.000	611,826,000
ロート製薬	85,100	3,648.000	310,444,800
小野薬品工業	179,100	1,941.500	347,722,650
久光製薬	19,900	4,040.000	80,396,000
持田製薬	11,300	3,245.000	36,668,500
参天製薬	154,600	1,812.000	280,135,200
扶桑薬品工業	4,500	2,214.000	9,963,000
ツムラ	27,700	3,941.000	109,165,700
キッセイ薬品工業	15,500	3,555.000	55,102,500
生化学工業	19,000	812.000	15,428,000
栄研化学	17,300	2,350.000	40,655,000
鳥居薬品	5,300	3,620.000	19,186,000
J C R ファーマ	31,800	644.000	20,479,200
東和薬品	14,500	2,920.000	42,340,000
富士製薬工業	7,900	1,270.000	10,033,000
ゼリア新薬工業	13,500	2,264.000	30,564,000
ネクセラファーマ	40,500	1,283.000	51,961,500
第一三共	765,000	5,275.000	4,035,375,000
杏林製薬	21,900	1,534.000	33,594,600
大幸薬品	24,400	411.000	10,028,400
ダイト	8,000	2,315.000	18,520,000
大塚ホールディングス	219,100	8,156.000	1,786,979,600
ペプチドリーム	43,000	2,550.000	109,650,000
セルソース	8,600	1,397.000	12,014,200
あすか製薬ホールディングス	9,900	2,206.000	21,839,400
サワイグループホールディングス	20,000	6,296.000	125,920,000

日本コークス工業	95,100	96.000	9,129,600
ニチレキ	11,800	2,456.000	28,980,800
ユシロ化学工業	4,500	1,556.000	7,002,000
富士石油	26,200	362.000	9,484,400
出光興産	455,700	1,005.500	458,206,350
E N E O Sホールディングス	1,387,000	747.300	1,036,505,100
コスモエネルギーホールディングス	26,100	7,527.000	196,454,700
横浜ゴム	44,100	3,117.000	137,459,700
TOYO TIRE	49,700	2,037.000	101,238,900
ブリヂストン	257,000	5,375.000	1,381,375,000
住友ゴム工業	85,100	1,506.500	128,203,150
藤倉コンポジット	7,100	1,198.000	8,505,800
オカモト	4,100	5,200.000	21,320,000
フコク	5,000	1,709.000	8,545,000
ニッタ	9,100	3,675.000	33,442,500
住友理工	14,000	1,487.000	20,818,000
三ツ星ベルト	10,500	3,980.000	41,790,000
パンドー化学	12,700	1,791.000	22,745,700
日東紡績	11,200	5,220.000	58,464,000
A G C	85,400	4,403.000	376,016,200
日本山村硝子	2,700	1,493.000	4,031,100
日本電気硝子	35,000	3,227.000	112,945,000
オハラ	5,300	1,354.000	7,176,200
住友大阪セメント	14,600	3,772.000	55,071,200
太平洋セメント	51,300	3,026.000	155,233,800
日本ヒューム	8,400	1,292.000	10,852,800
日本コンクリート工業	19,100	351.000	6,704,100
三谷セキサン	4,000	5,630.000	22,520,000
アジアパイルホールディングス	13,500	822.000	11,097,000
東海カーボン	78,700	840.100	66,115,870
日本カーボン	4,700	4,290.000	20,163,000
東洋炭素	6,100	5,070.000	30,927,000
ノリタケ	9,600	3,745.000	35,952,000
T O T O	58,100	4,800.000	278,880,000
日本碍子	100,700	1,849.500	186,244,650
日本特殊陶業	72,900	4,024.000	293,349,600
ダントーホールディングス	3,600	401.000	1,443,600
M A R U W A	3,200	35,200.000	112,640,000
品川リフラクトリーズ	10,700	1,691.000	18,093,700
黒崎播磨	7,200	2,082.000	14,990,400
ヨータイ	5,000	1,724.000	8,620,000
東京窯業	10,700	411.000	4,397,700
フジインコーポレーテッド	23,800	2,181.000	51,907,800
ニチアス	21,800	5,150.000	112,270,000
ニチハ	10,900	3,465.000	37,768,500
日本製鉄	420,200	3,021.000	1,269,424,200
神戸製鋼所	179,900	1,666.000	299,713,400
中山製鋼所	19,400	787.000	15,267,800

合同製鐵	4,700	4,225.000	19,857,500
J F E ホールディングス	250,500	1,886.000	472,443,000
東京製鐵	25,500	1,891.000	48,220,500
共英製鋼	9,600	1,670.000	16,032,000
大和工業	16,800	7,065.000	118,692,000
東京鐵鋼	4,000	5,100.000	20,400,000
大阪製鐵	5,300	3,300.000	17,490,000
淀川製鋼所	9,800	5,460.000	53,508,000
中部鋼鉄	6,500	2,271.000	14,761,500
丸一鋼管	27,300	3,396.000	92,710,800
モリ工業	2,000	5,260.000	10,520,000
大同特殊鋼	56,000	1,349.000	75,544,000
日本冶金工業	6,300	4,390.000	27,657,000
山陽特殊製鋼	9,000	1,842.000	16,578,000
愛知製鋼	5,100	3,285.000	16,753,500
日本金属	3,600	638.000	2,296,800
大平洋金属	8,100	1,301.000	10,538,100
新日本電工	48,000	284.000	13,632,000
栗本鐵工所	4,500	4,110.000	18,495,000
三菱製鋼	6,400	1,305.000	8,352,000
日本精線	7,300	1,075.000	7,847,500
エンビプロ・ホールディングス	8,400	482.000	4,048,800
新家工業	1,900	4,830.000	9,177,000
大紀アルミニウム工業所	12,200	1,067.000	13,017,400
日本軽金属ホールディングス	25,900	1,543.000	39,963,700
三井金属鉱業	26,200	4,380.000	114,756,000
三菱マテリアル	64,600	2,376.500	153,521,900
住友金属鉱山	105,200	3,533.000	371,671,600
D O W A ホールディングス	22,400	4,774.000	106,937,600
古河機械金属	12,900	1,577.000	20,343,300
大阪チタニウムテクノロジーズ	16,100	2,335.000	37,593,500
東邦チタニウム	19,600	1,034.000	20,266,400
U A C J	12,800	5,100.000	65,280,000
C K サンエツ	2,300	3,330.000	7,659,000
古河電気工業	30,300	3,159.000	95,717,700
住友電気工業	338,400	2,289.000	774,597,600
フジクラ	106,800	3,867.000	412,995,600
S W C C	10,400	5,210.000	54,184,000
平河ヒューテック	6,300	1,430.000	9,009,000
リョービ	9,700	1,920.000	18,624,000
アーレスティ	7,100	583.000	4,139,300
A R E ホールディングス	34,300	1,827.000	62,666,100
稲葉製作所	6,200	1,724.000	10,688,800
宮地エンジニアリンググループ	5,200	4,190.000	21,788,000
トーカロ	26,400	1,728.000	45,619,200
アルファ	3,900	1,198.000	4,672,200
S U M C O	171,700	1,470.000	252,399,000
川田テクノロジーズ	6,900	2,580.000	17,802,000

RS TECHNOLOGIES	6,500	3,210.000	20,865,000
ジェイテックコーポレーション	1,600	1,496.000	2,393,600
信和	7,900	762.000	6,019,800
東洋製罐グループホールディングス	51,700	2,280.000	117,876,000
ホッカンホールディングス	5,100	1,650.000	8,415,000
横河ブリッジホールディングス	14,300	2,601.000	37,194,300
駒井ハルテック	800	1,639.000	1,311,200
三和ホールディングス	89,700	3,417.000	306,504,900
文化シャッター	24,300	1,639.000	39,827,700
三協立山	11,300	718.000	8,113,400
アルインコ	7,700	980.000	7,546,000
LIXIL	140,400	1,713.000	240,505,200
ノーリツ	15,200	1,893.000	28,773,600
長府製作所	9,600	2,005.000	19,248,000
リンナイ	42,900	3,444.000	147,747,600
日東精工	13,700	544.000	7,452,800
岡部	16,300	746.000	12,159,800
ジーテクト	10,800	1,594.000	17,215,200
東プレ	15,300	1,794.000	27,448,200
高周波熱錬	14,700	1,002.000	14,729,400
東京製綱	5,800	1,054.000	6,113,200
パイオラックス	12,000	2,325.000	27,900,000
エイチワン	9,600	887.000	8,515,200
日本発条	79,400	1,712.500	135,972,500
中央発條	5,400	1,150.000	6,210,000
立川ブラインド工業	4,400	1,274.000	5,605,600
日本製鋼所	24,300	4,160.000	101,088,000
三浦工業	37,100	3,445.000	127,809,500
タクマ	29,500	1,559.000	45,990,500
ツガミ	18,700	1,445.000	27,021,500
オークマ	7,800	5,593.000	43,625,400
芝浦機械	8,500	3,635.000	30,897,500
アマダ	134,800	1,445.500	194,853,400
アイダエンジニアリング	18,000	780.000	14,040,000
FUJ I	40,800	2,238.500	91,330,800
牧野フライス製作所	9,500	5,440.000	51,680,000
オーエスジー	38,500	1,953.500	75,209,750
旭ダイヤモンド工業	21,200	830.000	17,596,000
D M G 森精機	55,500	3,104.000	172,272,000
ソディック	22,400	747.000	16,732,800
ディスコ	42,600	33,630.000	1,432,638,000
日東工器	4,300	2,381.000	10,238,300
日進工具	7,100	747.000	5,303,700
富士ダイス	5,800	765.000	4,437,000
豊和工業	5,500	783.000	4,306,500
石川製作所	3,100	1,352.000	4,191,200
リケンN P R	9,200	2,319.000	21,334,800
島精機製作所	13,500	1,324.000	17,874,000

オプトラン	14,500	1,649.000	23,910,500
イワキ	6,100	2,709.000	16,524,900
フリー	9,200	1,030.000	9,476,000
ヤマシンフィルタ	21,800	444.000	9,679,200
日阪製作所	8,800	1,090.000	9,592,000
やまびこ	13,900	2,232.000	31,024,800
野村マイクロ・サイエンス	12,000	2,361.000	28,332,000
平田機工	4,000	4,725.000	18,900,000
PEGASUS	11,000	475.000	5,225,000
マルマエ	4,300	1,436.000	6,174,800
タツモ	6,400	2,722.000	17,420,800
ナブテスコ	55,700	2,293.000	127,720,100
三井海洋開発	11,200	2,680.000	30,016,000
レオン自動機	9,900	1,330.000	13,167,000
S M C	26,500	58,760.000	1,557,140,000
ホソカワミクロン	6,000	4,105.000	24,630,000
ユニオンツール	3,800	5,700.000	21,660,000
瑞光	7,300	1,187.000	8,665,100
オイレス工業	11,100	2,059.000	22,854,900
日精エー・エス・ビー機械	3,400	4,680.000	15,912,000
サトーホールディングス	11,600	1,915.000	22,214,000
技研製作所	8,100	1,753.000	14,199,300
日本エアーテック	5,400	1,141.000	6,161,400
日精樹脂工業	6,400	930.000	5,952,000
ワイエイシイホールディングス	3,900	2,007.000	7,827,300
小松製作所	414,500	3,658.000	1,516,241,000
住友重機械工業	51,500	3,238.000	166,757,000
日立建機	35,000	3,383.000	118,405,000
日工	11,000	683.000	7,513,000
巴工業	3,700	3,965.000	14,670,500
井関農機	8,400	981.000	8,240,400
T O W A	9,900	5,880.000	58,212,000
ローツェ	46,000	1,797.000	82,662,000
クボタ	462,400	2,008.000	928,499,200
荏原実業	4,400	3,680.000	16,192,000
三菱化工機	3,000	3,390.000	10,170,000
月島ホールディングス	11,500	1,282.000	14,743,000
帝国電機製作所	5,900	2,567.000	15,145,300
新東工業	16,700	971.000	16,215,700
澁谷工業	8,100	3,405.000	27,580,500
アイチコーポレーション	12,200	1,143.000	13,944,600
小森コーポレーション	21,300	1,113.000	23,706,900
鶴見製作所	7,500	3,640.000	27,300,000
酒井重工業	1,400	4,405.000	6,167,000
荏原製作所	181,300	1,751.000	317,456,300
西島製作所	7,600	2,602.000	19,775,200
北越工業	9,000	1,798.000	16,182,000
ダイキン工業	105,600	16,925.000	1,787,280,000

オルガノ	10,600	6,270.000	66,462,000
トーヨーカネツ	2,900	3,955.000	11,469,500
栗田工業	49,900	5,493.000	274,100,700
椿本チエイン	11,800	5,600.000	66,080,000
大同工業	6,300	751.000	4,731,300
木村化工機	8,700	693.000	6,029,100
アネスト岩田	13,200	1,250.000	16,500,000
ダイフク	149,200	2,557.500	381,579,000
サムコ	2,300	3,470.000	7,981,000
加藤製作所	3,200	1,197.000	3,830,400
タダノ	50,200	933.500	46,861,700
フジテック	20,800	4,690.000	97,552,000
C K D	24,300	2,596.000	63,082,800
平和	26,700	2,119.000	56,577,300
理想科学工業	7,400	3,455.000	25,567,000
S A N K Y O	88,000	2,140.500	188,364,000
日本金銭機械	10,800	942.000	10,173,600
マースグループホールディングス	4,800	3,595.000	17,256,000
フクシマガリレイ	5,900	5,220.000	30,798,000
ダイコク電機	4,600	3,375.000	15,525,000
竹内製作所	15,600	4,150.000	64,740,000
アマノ	25,100	4,242.000	106,474,200
ジャノメ	9,400	817.000	7,679,800
マックス	12,000	3,560.000	42,720,000
グローリー	20,700	2,623.000	54,296,100
新晃工業	8,800	4,725.000	41,580,000
大和冷機工業	13,500	1,474.000	19,899,000
セガサミーホールディングス	79,100	2,884.000	228,124,400
T P R	10,000	2,227.000	22,270,000
ツバキ・ナカシマ	19,300	673.000	12,988,900
ホシザキ	58,200	4,549.000	264,751,800
大豊工業	9,000	602.000	5,418,000
日本精工	161,100	713.700	114,977,070
N T N	185,600	255.000	47,328,000
ジェイテクト	77,000	1,076.000	82,852,000
不二越	6,300	3,010.000	18,963,000
日本トムソン	21,800	473.000	10,311,400
T H K	50,700	2,490.000	126,243,000
ユーシン精機	7,900	624.000	4,929,600
前澤給装工業	6,900	1,295.000	8,935,500
イーグル工業	9,500	2,008.000	19,076,000
前澤工業	4,900	1,286.000	6,301,400
P I L L A R	7,900	3,975.000	31,402,500
キッツ	29,500	979.000	28,880,500
マキタ	101,000	4,593.000	463,893,000
三井E & S	43,700	1,168.000	51,041,600
日立造船	77,500	945.000	73,237,500
三菱重工業	1,546,700	1,696.500	2,623,976,550

I H I	66,800	6,250.000	417,500,000
スター精密	15,300	1,868.000	28,580,400
日清紡ホールディングス	65,000	913.500	59,377,500
イビデン	46,300	4,188.000	193,904,400
コニカミノルタ	197,300	415.500	81,978,150
ブラザー工業	117,800	2,791.500	328,838,700
ミネベアミツミ	153,900	2,636.000	405,680,400
日立製作所	2,125,600	3,300.000	7,014,480,000
三菱電機	969,400	2,232.000	2,163,700,800
富士電機	53,800	7,486.000	402,746,800
東洋電機製造	5,000	1,056.000	5,280,000
安川電機	96,100	4,352.000	418,227,200
シンフォニア テクノロジー	10,000	4,360.000	43,600,000
明電舎	16,400	3,045.000	49,938,000
オリジン	3,500	1,193.000	4,175,500
山洋電気	3,600	9,430.000	33,948,000
デンヨー	6,900	2,400.000	16,560,000
KOKUSAI ELECTRIC	46,400	3,155.000	146,392,000
ソシオネクスト	64,600	2,755.000	177,973,000
東芝テック	11,400	3,355.000	38,247,000
芝浦メカトロニクス	5,000	7,430.000	37,150,000
マブチモーター	42,100	2,165.500	91,167,550
ニデック	195,500	5,694.000	1,113,177,000
トレックス・セミコンダクター	4,800	1,505.000	7,224,000
東光高岳	5,300	1,766.000	9,359,800
ダイヘン	8,300	6,160.000	51,128,000
ヤーマン	17,100	836.000	14,295,600
JVCケンウッド	69,900	1,309.000	91,499,100
ミマキエンジニアリング	9,000	1,492.000	13,428,000
I - P E X	6,200	1,523.000	9,442,600
大崎電気工業	21,000	715.000	15,015,000
オムロン	67,700	5,757.000	389,748,900
日東工業	11,400	3,065.000	34,941,000
I D E C	12,700	2,506.000	31,826,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	34,200	2,886.500	98,718,300
サクサ	1,700	2,342.000	3,981,400
メルコホールディングス	3,300	3,720.000	12,276,000
日本電気	116,200	12,550.000	1,458,310,000
富士通	814,300	2,788.000	2,270,268,400
沖電気工業	39,200	956.000	37,475,200
電気興業	3,700	2,012.000	7,444,400
サンケン電気	8,300	6,435.000	53,410,500
アイホン	4,900	2,868.000	14,053,200
ルネサスエレクトロニクス	674,200	2,115.500	1,426,270,100
セイコーエプソン	113,200	2,589.000	293,074,800
ワコム	64,900	653.000	42,379,700
アルバック	19,400	7,316.000	141,930,400
アクセル	4,400	1,281.000	5,636,400

E I Z O	6,300	4,360.000	27,468,000
日本信号	19,000	943.000	17,917,000
京三製作所	19,500	498.000	9,711,000
能美防災	12,200	2,596.000	31,671,200
ホーチキ	7,400	1,898.000	14,045,200
エレコム	21,200	1,436.000	30,443,200
パナソニック ホールディングス	1,044,400	1,213.500	1,267,379,400
シャープ	147,000	899.200	132,182,400
アンリツ	62,200	1,081.500	67,269,300
富士通ゼネラル	25,300	1,958.500	49,550,050
ソニーグループ	613,400	13,195.000	8,093,813,000
T D K	140,100	8,938.000	1,252,213,800
帝国通信工業	4,100	2,404.000	9,856,400
タムラ製作所	36,200	593.000	21,466,600
アルプスアルパイン	79,300	1,474.500	116,927,850
日本電波工業	10,800	1,055.000	11,394,000
鈴木	5,300	1,583.000	8,389,900
メイコー	8,900	5,640.000	50,196,000
日本トリム	2,200	3,590.000	7,898,000
フォスター電機	8,200	1,576.000	12,923,200
S M K	2,500	2,229.000	5,572,500
ヨコオ	7,500	1,579.000	11,842,500
ホシデン	19,600	2,079.000	40,748,400
ヒロセ電機	12,800	18,385.000	235,328,000
日本航空電子工業	21,100	2,450.000	51,695,000
T O A	10,100	929.000	9,382,900
マクセル	19,000	1,801.000	34,219,000
古野電気	11,500	1,638.000	18,837,000
スミダコーポレーション	11,500	897.000	10,315,500
アイコム	3,600	2,686.000	9,669,600
リオン	3,800	1,997.000	7,588,600
横河電機	96,800	3,525.000	341,220,000
新電元工業	3,400	2,361.000	8,027,400
アズビル	60,200	4,690.000	282,338,000
東亜ディーケーケー	5,600	847.000	4,743,200
日本光電工業	73,800	1,978.000	145,976,400
チノー	3,700	2,164.000	8,006,800
日本電子材料	6,500	2,271.000	14,761,500
堀場製作所	16,500	8,654.000	142,791,000
アドバンテスト	251,000	5,899.000	1,480,649,000
エスベック	7,100	2,400.000	17,040,000
キーエンス	87,600	63,470.000	5,559,972,000
日置電機	4,600	8,110.000	37,306,000
シスメックス	227,100	2,710.000	615,441,000
日本マイクロニクス	15,600	3,700.000	57,720,000
メガチップス	6,800	5,150.000	35,020,000
O B A R A G R O U P	5,900	3,870.000	22,833,000
コーセル	9,800	1,165.000	11,417,000



イリソ電子工業	7,800	2,513.000	19,601,400
オプテックスグループ	15,600	1,657.000	25,849,200
千代田インテグレ	3,800	3,640.000	13,832,000
レーザーテック	40,100	22,010.000	882,601,000
スタンレー電気	56,000	2,781.500	155,764,000
ウシオ電機	42,300	2,040.000	86,292,000
日本セラミック	10,000	2,463.000	24,630,000
遠藤照明	3,200	1,286.000	4,115,200
山一電機	7,700	2,418.000	18,618,600
図研	7,400	3,285.000	24,309,000
日本電子	21,900	5,465.000	119,683,500
カシオ計算機	63,200	1,160.000	73,312,000
ファナック	423,900	3,800.000	1,610,820,000
日本シイエムケイ	19,800	396.000	7,840,800
エンプラス	2,600	6,010.000	15,626,000
大真空	12,700	593.000	7,531,100
ローム	158,900	1,534.000	243,752,600
浜松ホトニクス	70,100	3,454.000	242,125,400
三井ハイテック	38,800	933.700	36,227,560
新光電気工業	29,100	5,465.000	159,031,500
京セラ	544,100	1,691.500	920,345,150
太陽誘電	42,700	2,984.500	127,438,150
村田製作所	782,400	2,700.500	2,112,871,200
双葉電子工業	17,400	503.000	8,752,200
北陸電気工業	3,200	1,340.000	4,288,000
ニチコン	21,200	951.000	20,161,200
K O A	12,700	1,182.000	15,011,400
市光工業	15,900	415.000	6,598,500
小糸製作所	91,100	1,998.500	182,063,350
ミツバ	16,200	922.000	14,936,400
S C R E E Nホールディングス	29,900	9,886.000	295,591,400
キヤノン電子	9,100	2,196.000	19,983,600
キヤノン	436,900	4,825.000	2,108,042,500
リコー	219,500	1,495.000	328,152,500
象印マホービン	32,000	1,706.000	54,592,000
東京エレクトロン	185,300	22,260.000	4,124,778,000
イノテック	6,500	1,455.000	9,457,500
トヨタ紡織	35,700	1,845.000	65,866,500
ユニプレス	15,100	1,111.000	16,776,100
豊田自動織機	75,500	10,660.000	804,830,000
モリタホールディングス	14,600	1,957.000	28,572,200
三櫻工業	13,000	744.000	9,672,000
デンソー	720,700	2,028.000	1,461,579,600
東海理化電機製作所	25,100	1,923.000	48,267,300
川崎重工業	72,100	4,507.000	324,954,700
名村造船所	26,100	1,483.000	38,706,300
日本車輛製造	3,300	2,106.000	6,949,800
三菱ロジスネクスト	15,200	1,210.000	18,392,000

日産自動車	1,149,100	402.500	462,512,750
いすゞ自動車	247,700	2,043.000	506,051,100
トヨタ自動車	4,655,300	2,499.500	11,635,922,350
日野自動車	133,400	414.500	55,294,300
三菱自動車工業	344,600	397.000	136,806,200
武蔵精密工業	22,300	1,927.000	42,972,100
日産車体	6,700	947.000	6,344,900
新明和工業	25,900	1,274.000	32,996,600
極東開発工業	14,300	2,637.000	37,709,100
トピー工業	7,100	1,961.000	13,923,100
ティラド	2,400	3,550.000	8,520,000
タチエス	16,300	1,900.000	30,970,000
N O K	34,100	2,329.000	79,418,900
フタバ産業	23,900	677.000	16,180,300
カヤバ	7,900	4,515.000	35,668,500
大同メタル工業	19,500	481.000	9,379,500
プレス工業	36,200	578.000	20,923,600
太平洋工業	18,400	1,373.000	25,263,200
アイシン	63,000	4,861.000	306,243,000
マツダ	283,700	1,091.000	309,516,700
今仙電機製作所	6,300	565.000	3,559,500
本田技研工業	2,072,600	1,486.500	3,080,919,900
スズキ	643,200	1,529.500	983,774,400
S U B A R U	270,900	2,511.000	680,229,900
安永	4,400	583.000	2,565,200
ヤマハ発動機	370,700	1,213.000	449,659,100
エクセディ	13,800	3,015.000	41,607,000
豊田合成	23,800	2,422.000	57,643,600
愛三工業	14,000	1,422.000	19,908,000
日本プラスト	10,500	369.000	3,874,500
ヨロズ	9,500	1,060.000	10,070,000
エフ・シー・シー	14,200	2,397.000	34,037,400
シマノ	38,300	25,765.000	986,799,500
テイ・エス テック	32,200	1,804.000	58,088,800
ジャムコ	7,900	1,271.000	10,040,900
テルモ	488,300	2,597.500	1,268,359,250
日機装	19,100	988.000	18,870,800
日本エム・ディ・エム	6,000	725.000	4,350,000
島津製作所	116,200	4,591.000	533,474,200
長野計器	6,200	2,452.000	15,202,400
プイ・テクノロジー	4,700	2,527.000	11,876,900
東京計器	6,700	2,541.000	17,024,700
愛知時計電機	3,800	2,000.000	7,600,000
インターアクション	5,500	1,194.000	6,567,000
オーバル	7,300	373.000	2,722,900
東京精密	18,000	6,906.000	124,308,000
マニー	35,200	1,863.500	65,595,200
ニコン	126,100	1,426.500	179,881,650

トプコン	42,800	1,460.500	62,509,400
オリンパス	501,800	2,529.500	1,269,303,100
理研計器	12,700	3,745.000	47,561,500
タムロン	12,000	4,475.000	53,700,000
HOYA	172,400	19,015.000	3,278,186,000
ノーリツ鋼機	8,200	4,290.000	35,178,000
A & D ホロンホールディングス	12,500	2,176.000	27,200,000
朝日インテック	106,900	2,740.000	292,906,000
シチズン時計	78,600	912.000	71,683,200
リズム	1,300	3,825.000	4,972,500
メニコン	30,500	1,307.500	39,878,750
松風	4,000	4,850.000	19,400,000
セイコーグループ	12,400	3,725.000	46,190,000
ニプロ	73,300	1,363.000	99,907,900
パラマウントベッドホールディングス	18,900	2,470.000	46,683,000
トランザクション	6,100	2,035.000	12,413,500
ニホンフラッシュ	8,600	904.000	7,774,400
前田工織	15,200	1,676.000	25,475,200
永大産業	17,800	220.000	3,916,000
アートネイチャー	9,800	794.000	7,781,200
フルヤ金属	8,300	3,795.000	31,498,500
バンダイナムコホールディングス	235,400	3,254.000	765,991,600
SHOEI	24,400	2,194.000	53,533,600
フランスベッドホールディングス	10,500	1,210.000	12,705,000
パイロットコーポレーション	13,500	4,516.000	60,966,000
萩原工業	6,300	1,464.000	9,223,200
フジシールインターナショナル	17,400	2,323.000	40,420,200
タカラトミー	39,600	3,680.000	145,728,000
広済堂ホールディングス	29,800	488.000	14,542,400
プロネクサス	7,800	1,236.000	9,640,800
TOPPANホールディングス	104,700	4,281.000	448,220,700
大日本印刷	90,900	5,180.000	470,862,000
共同印刷	2,800	3,330.000	9,324,000
NISSHA	15,100	1,916.000	28,931,600
TAKARA & COMPANY	5,300	2,720.000	14,416,000
アシックス	323,400	2,689.000	869,622,600
ツツミ	3,200	2,163.000	6,921,600
ローランド	6,500	3,705.000	24,082,500
小松ウオール工業	3,300	2,989.000	9,863,700
ヤマハ	54,000	3,540.000	191,160,000
河合楽器製作所	2,900	2,730.000	7,917,000
クリナップ	9,800	714.000	6,997,200
ビジョン	55,700	1,566.500	87,254,050
キングジム	8,800	853.000	7,506,400
リンテック	17,100	3,185.000	54,463,500
イトーキ	17,500	1,441.000	25,217,500
任天堂	553,000	7,695.000	4,255,335,000
三菱鉛筆	12,200	2,425.000	29,585,000

タカラスタANDARD	17,700	1,553.000	27,488,100
コクヨ	43,200	2,535.500	109,533,600
グロープライド	7,100	1,830.000	12,993,000
オカムラ	25,600	2,011.000	51,481,600
美津濃	8,600	9,150.000	78,690,000
東京電力ホールディングス	790,500	644.900	509,793,450
中部電力	321,900	1,753.000	564,290,700
関西電力	338,000	2,436.500	823,537,000
中国電力	151,400	1,003.500	151,929,900
北陸電力	89,000	971.300	86,445,700
東北電力	229,700	1,378.000	316,526,600
四国電力	80,400	1,312.500	105,525,000
九州電力	201,300	1,583.500	318,758,550
北海道電力	84,300	1,030.000	86,829,000
沖縄電力	22,300	1,072.000	23,905,600
電源開発	72,100	2,366.000	170,588,600
エフオン	9,900	380.000	3,762,000
イーレックス	17,200	692.000	11,902,400
レノバ	24,800	929.000	23,039,200
東京瓦斯	170,800	3,538.000	604,290,400
大阪瓦斯	174,800	3,521.000	615,470,800
東邦瓦斯	38,200	4,277.000	163,381,400
北海道瓦斯	5,100	3,100.000	15,810,000
広島ガス	20,700	384.000	7,948,800
西部ガスホールディングス	9,000	1,875.000	16,875,000
静岡ガス	19,400	1,095.000	21,243,000
メタウォーター	10,900	1,695.000	18,475,500
SBSホールディングス	9,000	2,443.000	21,987,000
東武鉄道	96,000	2,595.500	249,168,000
相鉄ホールディングス	31,900	2,461.000	78,505,900
東急	247,000	1,885.000	465,595,000
京浜急行電鉄	109,200	1,190.000	129,948,000
小田急電鉄	145,500	1,757.000	255,643,500
京王電鉄	42,400	3,664.000	155,353,600
京成電鉄	56,800	4,572.000	259,689,600
富士急行	12,100	2,519.000	30,479,900
東日本旅客鉄道	483,600	2,874.000	1,389,866,400
西日本旅客鉄道	208,200	2,743.000	571,092,600
東海旅客鉄道	337,900	3,377.000	1,141,088,300
西武ホールディングス	106,700	3,614.000	385,613,800
鴻池運輸	16,800	2,401.000	40,336,800
西日本鉄道	23,400	2,304.500	53,925,300
ハマキョウレックス	7,200	4,895.000	35,244,000
サカイ引越センター	11,000	2,446.000	26,906,000
近鉄グループホールディングス	87,500	3,495.000	305,812,500
阪急阪神ホールディングス	117,000	4,537.000	530,829,000
南海電気鉄道	39,500	2,362.000	93,299,000
京阪ホールディングス	48,400	3,029.000	146,603,600

神戸電鉄	3,000	2,608.000	7,824,000
名古屋鉄道	90,700	1,727.500	156,684,250
山陽電気鉄道	6,500	2,012.000	13,078,000
ヤマトホールディングス	107,300	1,592.500	170,875,250
山九	21,500	4,790.000	102,985,000
丸全昭和運輸	5,900	4,870.000	28,733,000
センコーグループホールディングス	46,900	1,226.000	57,499,400
トナミホールディングス	2,000	5,920.000	11,840,000
ニッコンホールディングス	27,200	3,752.000	102,054,400
福山通運	9,800	3,790.000	37,142,000
セイノーホールディングス	49,700	2,408.500	119,702,450
神奈川中央交通	3,000	3,340.000	10,020,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	25,600	1,107.000	28,339,200
九州旅客鉄道	61,900	4,123.000	255,213,700
S Gホールディングス	147,900	1,578.500	233,460,150
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	32,600	7,186.000	234,263,600
日本郵船	226,100	4,630.000	1,046,843,000
商船三井	189,100	4,688.000	886,500,800
川崎汽船	210,400	1,919.500	403,862,800
N Sユナイテッド海運	4,800	4,290.000	20,592,000
明海グループ	7,400	701.000	5,187,400
飯野海運	33,200	1,173.000	38,943,600
乾汽船	12,600	1,127.000	14,200,200
日本航空	213,700	2,430.500	519,397,850
A N Aホールディングス	238,500	2,999.000	715,261,500
トランコム	2,600	7,100.000	18,460,000
日新	6,700	4,260.000	28,542,000
三菱倉庫	20,500	5,255.000	107,727,500
三井倉庫ホールディングス	8,100	5,900.000	47,790,000
住友倉庫	22,800	2,727.000	62,175,600
澁澤倉庫	3,300	2,942.000	9,708,600
東陽倉庫	3,700	1,338.000	4,950,600
日本トランスシティ	17,900	875.000	15,662,500
川西倉庫	5,200	1,151.000	5,985,200
安田倉庫	6,600	1,664.000	10,982,400
上組	40,100	3,355.000	134,535,500
キムラユニティー	4,000	1,472.000	5,888,000
キューソー流通システム	6,700	1,938.000	12,984,600
エーアイティー	5,400	1,662.000	8,974,800
内外トランスライン	3,500	2,686.000	9,401,000
日本コンセプト	3,300	1,677.000	5,534,100
N E C ネットズエスアイ	33,900	2,678.000	90,784,200
クロスキャット	7,100	1,149.000	8,157,900
システナ	134,900	381.000	51,396,900
デジタルアーツ	5,400	4,375.000	23,625,000
日鉄ソリューションズ	30,600	3,655.000	111,843,000
キューブシステム	3,500	1,047.000	3,664,500

コア	3,300	1,772.000	5,847,600
手間いらず	1,900	3,470.000	6,593,000
ラクーンホールディングス	8,100	725.000	5,872,500
ソリトンシステムズ	4,800	1,061.000	5,092,800
ソフトクリエイトホールディングス	7,100	1,706.000	12,112,600
T I S	92,700	3,546.000	328,714,200
グリー	30,500	446.000	13,603,000
コーエーテクモホールディングス	55,000	1,587.500	87,312,500
三菱総合研究所	3,900	4,080.000	15,912,000
ファインデックス	7,900	869.000	6,865,100
ブレインパッド	7,500	859.000	6,442,500
ポルトゥウィンホールディングス	15,000	412.000	6,180,000
ネクソン	193,100	2,716.500	524,556,150
アイスタイル	29,900	529.000	15,817,100
エムアップホールディングス	11,100	1,273.000	14,130,300
エイチーム	6,700	650.000	4,355,000
エニグモ	12,700	326.000	4,140,200
コロプラ	32,000	561.000	17,952,000
ブロードリーフ	43,900	687.000	30,159,300
デジタルハーツホールディングス	5,700	812.000	4,628,400
メディアドゥ	4,300	1,418.000	6,097,400
じげん	25,500	581.000	14,815,500
フィックスターズ	9,800	1,472.000	14,425,600
C A R T A H O L D I N G S	4,600	1,343.000	6,177,800
オブティム	8,500	611.000	5,193,500
セレス	4,000	1,266.000	5,064,000
S H I F T	5,900	11,765.000	69,413,500
ティーガイア	9,500	3,840.000	36,480,000
セック	1,300	4,160.000	5,408,000
テクマトリックス	16,800	2,357.000	39,597,600
プロシップ	3,900	1,428.000	5,569,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	22,800	3,034.000	69,175,200
G M O ペイメントゲートウェイ	20,100	8,833.000	177,543,300
システムリサーチ	5,600	1,445.000	8,092,000
インターネットイニシアティブ	41,900	2,932.000	122,850,800
さくらインターネット	11,100	3,755.000	41,680,500
G M O グローバルサイン・ホールディングス	2,700	2,754.000	7,435,800
S R A ホールディングス	4,200	4,330.000	18,186,000
朝日ネット	5,600	659.000	3,690,400
e B A S E	12,200	583.000	7,112,600
アバントグループ	10,700	2,071.000	22,159,700
アドソル日進	3,500	1,734.000	6,069,000
フリービット	4,600	1,225.000	5,635,000
コムチュア	12,300	1,545.000	19,003,500
アイル	5,400	2,795.000	15,093,000
マークライنز	5,000	2,995.000	14,975,000
メディカル・データ・ビジョン	12,600	513.000	6,463,800
テラスカイ	4,300	2,185.000	9,395,500

デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,700	2,006.000	9,428,200
ネオジャパン	3,200	1,779.000	5,692,800
P R T I M E S	2,200	1,720.000	3,784,000
ラクス	41,700	2,257.500	94,137,750
ダブルスタンダード	3,400	1,514.000	5,147,600
オープンドア	6,300	693.000	4,365,900
アカツキ	4,500	2,014.000	9,063,000
U B I C O Mホールディングス	3,100	1,375.000	4,262,500
カナミックネットワーク	12,200	559.000	6,819,800
チェンジホールディングス	19,600	1,252.000	24,539,200
シンクロ・フード	2,300	510.000	1,173,000
オークネット	4,000	2,253.000	9,012,000
セグエグループ	4,500	653.000	2,938,500
マクロミル	17,000	758.000	12,886,000
オロ	3,700	2,478.000	9,168,600
ユーザーローカル	3,800	1,933.000	7,345,400
マネーフォワード	21,600	5,546.000	119,793,600
S U N A S T E R I S K	6,600	565.000	3,729,000
プラスアルファ・コンサルティング	11,300	2,136.000	24,136,800
電算システムホールディングス	4,200	2,614.000	10,978,800
A P P I E R G R O U P	30,100	1,694.000	50,989,400
ビジョナル	10,400	9,230.000	95,992,000
プロトコーポレーション	9,900	1,404.000	13,899,600
野村総合研究所	190,300	5,206.000	990,701,800
日本システム技術	8,400	1,901.000	15,968,400
インテージホールディングス	10,200	1,550.000	15,810,000
東邦システムサイエンス	3,800	1,454.000	5,525,200
シンプレクス・ホールディングス	13,500	2,451.000	33,088,500
H E R O Z	4,100	1,050.000	4,305,000
ラクスル	22,000	1,200.000	26,400,000
メルカリ	43,000	2,465.000	105,995,000
I P S	2,900	2,183.000	6,330,700
システムサポート	3,300	2,066.000	6,817,800
イーソル	7,500	725.000	5,437,500
ウイングアーク1 s t	9,500	2,921.000	27,749,500
サーバーワークス	2,100	2,842.000	5,968,200
S a n s a n	29,100	2,346.000	68,268,600
ギフトィ	8,000	1,141.000	9,128,000
メドレー	11,900	3,340.000	39,746,000
ベース	4,300	3,200.000	13,760,000
J M D C	15,200	4,454.000	67,700,800
フォーカスシステムズ	6,000	1,129.000	6,774,000
クレスコ	14,000	1,258.000	17,612,000
フジ・メディア・ホールディングス	83,500	1,754.500	146,500,750
オービック	29,400	25,360.000	745,584,000
ジャストシステム	12,600	3,520.000	44,352,000
T D C ソフト	16,800	1,170.000	19,656,000

LINEヤフー	1,235,900	398.300	492,258,970
トレンドマイクロ	46,200	8,544.000	394,732,800
IDホールディングス	5,900	1,360.000	8,024,000
日本オラクル	16,600	13,435.000	223,021,000
アルファシステムズ	2,500	2,828.000	7,070,000
フューチャー	21,800	1,820.000	39,676,000
CAC HOLDINGS	4,300	1,725.000	7,417,500
オービックビジネスコンサルタント	12,300	7,363.000	90,564,900
アイティフォー	10,900	1,330.000	14,497,000
東計電算	2,800	4,570.000	12,796,000
大塚商会	99,300	3,559.000	353,408,700
サイボウズ	12,700	1,601.000	20,332,700
電通総研	10,000	5,820.000	58,200,000
ACCESS	10,400	1,744.000	18,137,600
デジタルガレージ	14,300	2,897.000	41,427,100
イーエムシステムズ	14,500	528.000	7,656,000
ウェザーニューズ	2,700	5,630.000	15,201,000
CIJ	23,400	421.000	9,851,400
ビジネスエンジニアリング	1,900	4,125.000	7,837,500
WOWOW	7,000	1,063.000	7,441,000
スカラ	9,000	465.000	4,185,000
ANYCOLOR	12,700	2,311.000	29,349,700
IMAGICA GROUP	8,700	481.000	4,184,700
ネットワンシステムズ	34,800	3,644.000	126,811,200
システムソフト	27,400	61.000	1,671,400
アルゴグラフィックス	8,200	5,250.000	43,050,000
マーベラス	14,200	590.000	8,378,000
エイベックス	15,200	1,471.000	22,359,200
BIPROGY	28,700	4,952.000	142,122,400
都築電気	4,500	2,280.000	10,260,000
TBSホールディングス	44,000	4,071.000	179,124,000
日本テレビホールディングス	77,500	2,377.000	184,217,500
朝日放送グループホールディングス	9,600	637.000	6,115,200
テレビ朝日ホールディングス	20,800	2,000.000	41,600,000
スカパーJ SATホールディングス	67,900	855.000	58,054,500
テレビ東京ホールディングス	6,000	3,890.000	23,340,000
日本BS放送	3,500	889.000	3,111,500
ビジョン	13,400	1,314.000	17,607,600
U-NEXT HOLDINGS	10,100	5,620.000	56,762,000
日本通信	91,400	167.000	15,263,800
日本電信電話	26,116,700	150.200	3,922,728,340
KDDI	645,900	4,824.000	3,115,821,600
ソフトバンク	1,404,200	1,995.000	2,801,379,000
光通信	8,700	33,000.000	287,100,000
エムティーアイ	7,400	1,091.000	8,073,400
GMOインターネットグループ	31,700	2,467.500	78,219,750
ファイバーゲート	5,000	1,075.000	5,375,000
KADOKAWA	46,500	3,025.000	140,662,500



学研ホールディングス	14,600	993.000	14,497,800
ゼンリン	14,500	857.000	12,426,500
アイネット	5,600	1,516.000	8,489,600
松竹	4,700	10,310.000	48,457,000
東宝	48,800	5,958.000	290,750,400
東映	14,500	4,530.000	65,685,000
NTTデータグループ	230,300	2,343.000	539,592,900
ピー・シー・エー	5,700	1,967.000	11,211,900
ビジネスブレイン太田昭和	3,300	1,782.000	5,880,600
D T S	17,900	3,970.000	71,063,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	40,000	5,477.000	219,080,000
シーイーシー	11,700	1,711.000	20,018,700
カブコン	156,900	3,319.000	520,751,100
アイ・エス・ピー	4,600	1,410.000	6,486,000
S C S K	62,000	2,949.000	182,838,000
N S W	3,300	2,888.000	9,530,400
アイネス	6,400	1,524.000	9,753,600
T K C	14,900	3,745.000	55,800,500
富士ソフト	24,100	9,440.000	227,504,000
N S D	30,700	3,205.000	98,393,500
コナミグループ	32,900	13,700.000	450,730,000
福井コンピュータホールディングス	5,200	2,550.000	13,260,000
J B C Cホールディングス	5,900	4,375.000	25,812,500
ミロク情報サービス	7,900	1,860.000	14,694,000
ソフトバンクグループ	433,300	7,843.000	3,398,371,900
リョーサン菱洋ホールディングス	17,300	2,603.000	45,031,900
高千穂交易	3,000	3,860.000	11,580,000
伊藤忠食品	2,200	7,270.000	15,994,000
エレマテック	8,000	1,718.000	13,744,000
あらた	14,100	3,685.000	51,958,500
トーメンデバイス	1,400	5,570.000	7,798,000
東京エレクトロン デバイス	9,400	3,500.000	32,900,000
円谷フィールズホールディングス	16,800	2,005.000	33,684,000
双日	102,000	3,249.000	331,398,000
アルフレッサ ホールディングス	93,100	2,414.500	224,789,950
横浜冷凍	24,300	1,002.000	24,348,600
ラサ商事	5,000	1,457.000	7,285,000
アルコニックス	12,000	1,355.000	16,260,000
神戸物産	72,000	4,475.000	322,200,000
あい ホールディングス	15,000	2,378.000	35,670,000
ダイワボウホールディングス	40,800	2,779.000	113,383,200
マクニカホールディングス	21,700	5,707.000	123,841,900
ラクト・ジャパン	3,900	2,960.000	11,544,000
グリムス	3,900	2,497.000	9,738,300
バイタルケーエスケー・ホールディングス	14,200	1,229.000	17,451,800
八洲電機	6,900	1,517.000	10,467,300
メディアスホールディングス	7,000	775.000	5,425,000
レスター	8,000	2,612.000	20,896,000

ジオリーブグループ	1,600	1,132.000	1,811,200
TOKAIホールディングス	46,500	995.000	46,267,500
三洋貿易	9,900	1,454.000	14,394,600
ビューティガレージ	3,300	1,569.000	5,177,700
ウイン・パートナーズ	5,200	1,151.000	5,985,200
シップヘルスケアホールディングス	33,500	2,126.000	71,221,000
スターティアホールディングス	1,000	2,010.000	2,010,000
コメダホールディングス	22,800	2,717.000	61,947,600
フルサト・マルカホールディングス	8,300	2,201.000	18,268,300
ヤマエグループホールディングス	9,100	1,988.000	18,090,800
小野建	8,700	1,484.000	12,910,800
南陽	5,000	1,049.000	5,245,000
佐島電機	6,300	1,869.000	11,774,700
エコートレーディング	2,500	918.000	2,295,000
伯東	5,200	4,685.000	24,362,000
コンドーテック	7,000	1,203.000	8,421,000
ナガイレーベン	12,000	2,506.000	30,072,000
三菱食品	9,300	5,130.000	47,709,000
松田産業	6,800	3,095.000	21,046,000
第一興商	34,500	1,696.500	58,529,250
メディバルホールディングス	94,000	2,673.000	251,262,000
S P K	4,200	2,001.000	8,404,200
萩原電気ホールディングス	4,300	3,455.000	14,856,500
アズワン	29,000	2,862.000	82,998,000
スズデン	3,800	1,853.000	7,041,400
尾家産業	2,500	2,016.000	5,040,000
シモジマ	6,600	1,298.000	8,566,800
ドウシシャ	8,800	2,157.000	18,981,600
高速	5,200	2,358.000	12,261,600
たけびし	3,400	2,369.000	8,054,600
リックス	2,300	2,819.000	6,483,700
丸文	8,300	1,037.000	8,607,100
ハピネット	9,400	4,045.000	38,023,000
日本ライフライン	25,900	1,178.000	30,510,200
タカショー	11,900	468.000	5,569,200
I D O M	26,300	1,060.000	27,878,000
進和	5,800	2,555.000	14,819,000
ダイترون	3,600	2,589.000	9,320,400
シークス	12,500	1,054.000	13,175,000
オーハシテクニカ	4,700	1,768.000	8,309,600
白銅	2,600	2,445.000	6,357,000
伊藤忠商事	622,800	7,572.000	4,715,841,600
丸紅	767,500	2,263.000	1,736,852,500
長瀬産業	41,100	3,127.000	128,519,700
蝶理	5,500	3,470.000	19,085,000
豊田通商	242,800	2,524.000	612,827,200
三共生興	14,800	578.000	8,554,400
兼松	37,100	2,450.000	90,895,000

三井物産	1,387,600	2,826.000	3,921,357,600
日本紙パルプ商事	4,600	6,450.000	29,670,000
カメイ	9,500	1,967.000	18,686,500
スターゼン	6,200	2,826.000	17,521,200
山善	27,200	1,383.000	37,617,600
椿本興業	6,000	1,740.000	10,440,000
住友商事	559,900	3,193.000	1,787,760,700
内田洋行	3,700	6,710.000	24,827,000
三菱商事	1,778,800	2,861.500	5,090,036,200
第一実業	9,200	2,378.000	21,877,600
キヤノンマーケティングジャパン	21,400	4,810.000	102,934,000
西華産業	4,000	3,860.000	15,440,000
佐藤商事	6,200	1,365.000	8,463,000
東京産業	8,900	698.000	6,212,200
ユアサ商事	7,300	5,070.000	37,011,000
神鋼商事	2,300	6,870.000	15,801,000
阪和興業	16,100	4,865.000	78,326,500
正栄食品工業	6,100	4,585.000	27,968,500
カナデン	6,700	1,389.000	9,306,300
RYODEN	7,100	2,475.000	17,572,500
岩谷産業	20,900	8,160.000	170,544,000
ナイス	2,600	1,895.000	4,927,000
極東貿易	5,400	1,495.000	8,073,000
アステナホールディングス	18,300	509.000	9,314,700
三愛オブリ	22,200	2,016.000	44,755,200
稲畑産業	17,400	3,285.000	57,159,000
G S Iクレオス	5,000	1,975.000	9,875,000
明和産業	12,500	643.000	8,037,500
ワキタ	16,100	1,614.000	25,985,400
東邦ホールディングス	25,100	5,007.000	125,675,700
サンゲツ	21,200	2,849.000	60,398,800
ミツウロコグループホールディングス	12,800	1,634.000	20,915,200
シナネンホールディングス	2,900	5,770.000	16,733,000
伊藤忠エネクス	22,900	1,598.000	36,594,200
サンリオ	76,200	3,866.000	294,589,200
サンワ テクノス	4,600	1,967.000	9,048,200
新光商事	12,600	878.000	11,062,800
トーヨー	4,000	2,639.000	10,556,000
三信電気	3,900	1,972.000	7,690,800
東陽テクニカ	9,100	1,620.000	14,742,000
モスフードサービス	13,300	3,465.000	46,084,500
加賀電子	8,000	5,300.000	42,400,000
ソーダニッカ	9,700	1,135.000	11,009,500
立花エレテック	6,400	2,608.000	16,691,200
フォーバル	1,700	1,349.000	2,293,300
PALTAC	13,100	4,523.000	59,251,300
三谷産業	19,000	322.000	6,118,000
太平洋興発	3,400	736.000	2,502,400

西本Wismettacホールディングス	6,900	1,378.000	9,508,200
コア商事ホールディングス	4,300	619.000	2,661,700
KPPグループホールディングス	24,800	669.000	16,591,200
ヤマタネ	4,500	3,245.000	14,602,500
泉州電業	6,500	4,550.000	29,575,000
トラスコ中山	18,900	2,559.000	48,365,100
オートバックスセブン	31,900	1,480.000	47,212,000
モリト	7,100	1,342.000	9,528,200
加藤産業	11,300	4,230.000	47,799,000
イエローハット	15,000	2,420.000	36,300,000
JKホールディングス	7,800	973.000	7,589,400
日伝	6,400	3,225.000	20,640,000
杉本商事	4,300	3,015.000	12,964,500
因幡電機産業	23,400	3,850.000	90,090,000
東テク	9,700	2,293.000	22,242,100
ミスミグループ本社	140,200	2,651.000	371,670,200
タキヒヨー	3,200	1,223.000	3,913,600
スズケン	34,300	5,278.000	181,035,400
ジェコス	6,100	907.000	5,532,700
サンエー	13,200	2,626.000	34,663,200
カワチ薬品	7,000	2,685.000	18,795,000
エービーシー・マート	41,600	3,085.000	128,336,000
ハードオフコーポレーション	3,500	1,908.000	6,678,000
アスクル	22,600	2,068.000	46,736,800
ゲオホールディングス	10,400	1,566.000	16,286,400
アダストリア	11,200	3,505.000	39,256,000
くら寿司	10,900	3,475.000	37,877,500
キャンドゥ	4,200	3,365.000	14,133,000
バルグループホールディングス	18,800	2,411.000	45,326,800
エディオン	35,000	1,862.000	65,170,000
サーラコーポレーション	18,900	823.000	15,554,700
ハローズ	4,000	4,125.000	16,500,000
フジオフードグループ本社	10,600	1,340.000	14,204,000
あみやき亭	2,400	5,850.000	14,040,000
大黒天物産	3,000	12,000.000	36,000,000
ハニーズホールディングス	8,000	1,607.000	12,856,000
アルペン	7,300	2,142.000	15,636,600
クオールホールディングス	12,400	1,430.000	17,732,000
ジンスホールディングス	7,400	5,240.000	38,776,000
ビックカメラ	55,700	1,581.000	88,061,700
DCMホールディングス	49,200	1,475.000	72,570,000
Monotaro	131,800	2,535.000	334,113,000
DDグループ	2,900	1,285.000	3,726,500
J.フロント リテイリング	106,000	1,462.000	154,972,000
ドトール・日レスホールディングス	15,400	2,293.000	35,312,200
マツキヨココカラ&カンパニー	168,400	2,204.500	371,237,800
broncoピラー	5,400	3,675.000	19,845,000
ZOZO	59,200	4,747.000	281,022,400

トレジャー・ファクトリー	6,600	1,734.000	11,444,400
物語コーポレーション	15,300	3,480.000	53,244,000
三越伊勢丹ホールディングス	153,100	2,176.000	333,145,600
H a m e e	4,900	1,149.000	5,630,100
ウエルシアホールディングス	48,500	2,003.000	97,145,500
クリエイティブSDホールディングス	13,500	3,140.000	42,390,000
チムニー	2,200	1,320.000	2,904,000
シュッピン	8,200	1,169.000	9,585,800
オイシックス・ラ・大地	12,500	1,422.000	17,775,000
ネクステージ	21,700	1,743.000	37,823,100
ジョイフル本田	25,700	2,127.000	54,663,900
エターナルホスピタリティグループ	3,600	3,045.000	10,962,000
ホットランド	7,200	2,340.000	16,848,000
すかいらーくホールディングス	126,200	2,364.500	298,399,900
S F Pホールディングス	4,600	1,987.000	9,140,200
綿半ホールディングス	6,100	1,728.000	10,540,800
ヨシックスホールディングス	2,000	3,285.000	6,570,000
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	841.000	27,584,800
B E E N O S	5,600	2,441.000	13,669,600
あさひ	7,500	1,580.000	11,850,000
日本調剤	6,400	1,244.000	7,961,600
コスモス薬品	15,600	7,419.000	115,736,400
セブン&アイ・ホールディングス	938,900	2,182.000	2,048,679,800
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	62,600	1,053.000	65,917,800
ツルハホールディングス	19,500	8,840.000	172,380,000
サンマルクホールディングス	7,000	2,083.000	14,581,000
フェリシモ	4,000	906.000	3,624,000
トリドールホールディングス	26,000	3,532.000	91,832,000
T O K Y O B A S E	11,600	233.000	2,702,800
J Mホールディングス	6,900	3,070.000	21,183,000
アレンザホールディングス	6,500	1,058.000	6,877,000
串カツ田中ホールディングス	800	1,454.000	1,163,200
クスリのアオキホールディングス	28,200	3,328.000	93,849,600
力の源ホールディングス	5,500	1,152.000	6,336,000
F O O D & L I F E C O M P A N I E S	49,500	2,606.000	128,997,000
メディカルシステムネットワーク	12,000	442.000	5,304,000
ノジマ	26,900	1,830.000	49,227,000
カッパ・クリエイティブ	14,400	1,720.000	24,768,000
良品計画	110,400	2,708.000	298,963,200
アドヴァングループ	4,900	906.000	4,439,400
アルビス	2,500	2,748.000	6,870,000
G - 7ホールディングス	9,800	1,574.000	15,425,200
イオン北海道	31,800	916.000	29,128,800
コジマ	17,900	925.000	16,557,500
コーナン商事	11,700	3,775.000	44,167,500

エコス	3,600	2,087.000	7,513,200
ワタミ	10,300	857.000	8,827,100
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	187,400	3,737.000	700,313,800
西松屋チェーン	18,400	2,527.000	46,496,800
ゼンショーホールディングス	47,300	7,640.000	361,372,000
幸楽苑ホールディングス	7,000	1,224.000	8,568,000
サイゼリヤ	13,900	5,190.000	72,141,000
V Tホールディングス	33,100	484.000	16,020,400
フジ・コーポレーション	4,200	2,110.000	8,862,000
ユナイテッドアローズ	10,500	2,228.000	23,394,000
ハイデイ日高	13,400	2,662.000	35,670,800
コロワイド	39,800	1,730.000	68,854,000
壱番屋	35,500	1,027.000	36,458,500
スギホールディングス	58,400	2,545.000	148,628,000
薬王堂ホールディングス	4,600	2,549.000	11,725,400
スクロール	13,200	944.000	12,460,800
ヨンドシーホールディングス	8,100	1,856.000	15,033,600
木曽路	13,600	2,417.000	32,871,200
S R Sホールディングス	14,900	1,245.000	18,550,500
リテールパートナーズ	13,000	1,360.000	17,680,000
上新電機	8,500	2,735.000	23,247,500
日本瓦斯	51,400	2,333.000	119,916,200
ロイヤルホールディングス	16,500	2,392.000	39,468,000
いなげや	8,600	1,198.000	10,302,800
チヨダ	9,500	938.000	8,911,000
ライフコーポレーション	9,400	3,625.000	34,075,000
リンガーハット	12,100	2,190.000	26,499,000
Mr Max HD	10,700	690.000	7,383,000
A O K Iホールディングス	19,300	1,211.000	23,372,300
オークワ	14,400	930.000	13,392,000
コメリ	14,100	3,780.000	53,298,000
青山商事	19,500	1,367.000	26,656,500
しまむら	22,500	7,955.000	178,987,500
高島屋	123,000	1,103.000	135,669,000
松屋	15,500	871.000	13,500,500
エイチ・ツー・オー リテイリング	48,600	2,141.000	104,052,600
近鉄百貨店	4,900	2,083.000	10,206,700
丸井グループ	61,000	2,551.000	155,611,000
アクシアル リテイリング	24,100	958.000	23,087,800
イオン	314,500	3,925.000	1,234,412,500
イズミ	18,900	3,653.000	69,041,700
平和堂	14,900	2,456.000	36,594,400
フジ	14,500	2,058.000	29,841,000
ヤオコー	11,100	10,240.000	113,664,000
ゼビオホールディングス	12,200	1,241.000	15,140,200
ケーズホールディングス	61,500	1,555.500	95,663,250
Genky Drug Stores	8,400	3,785.000	31,794,000

ブックオフグループホールディングス	6,600	1,297.000	8,560,200
ギフトホールディングス	4,700	2,588.000	12,163,600
アインホールディングス	12,900	5,277.000	68,073,300
GENKI GLOBAL DINING CONCEPTS	5,800	4,265.000	24,737,000
ヤマダホールディングス	288,200	450.900	129,949,380
アークランズ	27,100	1,723.000	46,693,300
ニトリホールディングス	33,800	22,340.000	755,092,000
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	2,900	1,041.000	3,018,900
吉野家ホールディングス	34,100	3,282.000	111,916,200
松屋フーズホールディングス	4,300	5,580.000	23,994,000
サガミホールディングス	13,800	1,688.000	23,294,400
王将フードサービス	6,700	8,410.000	56,347,000
ミニストップ	6,700	1,664.000	11,148,800
アークス	16,400	2,525.000	41,410,000
パローホールディングス	16,900	2,211.000	37,365,900
ベルク	4,600	6,280.000	28,888,000
大庄	5,500	1,058.000	5,819,000
ファーストリテイリング	52,100	43,640.000	2,273,644,000
サンドラッグ	33,000	4,307.000	142,131,000
サックスパーホールディングス	7,700	805.000	6,198,500
やまや	1,000	3,040.000	3,040,000
ペルーナ	21,200	717.000	15,200,400
いよぎんホールディングス	102,100	1,356.500	138,498,650
しずおかフィナンシャルグループ	188,700	1,275.000	240,592,500
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	72,700	1,487.500	108,141,250
楽天銀行	40,300	3,180.000	128,154,000
京都フィナンシャルグループ	108,800	2,186.000	237,836,800
じもとホールディングス	11,000	290.000	3,190,000
めぶきフィナンシャルグループ	405,700	562.100	228,043,970
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10,600	4,280.000	45,368,000
九州フィナンシャルグループ	166,700	679.700	113,305,990
ゆうちょ銀行	948,900	1,359.500	1,290,029,550
富山第一銀行	27,100	1,114.000	30,189,400
コンコルディア・フィナンシャルグループ	457,700	794.500	363,642,650
西日本フィナンシャルホールディングス	49,000	1,636.000	80,164,000
三十三フィナンシャルグループ	7,500	1,697.000	12,727,500
第四北越フィナンシャルグループ	13,400	4,895.000	65,593,000
ひろぎんホールディングス	119,900	1,105.000	132,489,500
おきなわフィナンシャルグループ	6,900	2,358.000	16,270,200
十六フィナンシャルグループ	10,600	4,055.000	42,983,000
北國フィナンシャルホールディングス	8,900	4,635.000	41,251,500
プロクレアホールディングス	10,800	1,794.000	19,375,200
あいちフィナンシャルグループ	18,600	2,399.000	44,621,400
あおぞら銀行	61,500	2,537.000	156,025,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	5,251,700	1,445.500	7,591,332,350
りそなホールディングス	989,100	1,066.000	1,054,380,600

三井住友トラスト・ホールディングス	306,600	3,481.000	1,067,274,600
三井住友フィナンシャルグループ	603,900	9,036.000	5,456,840,400
千葉銀行	239,500	1,154.500	276,502,750
群馬銀行	166,300	960.500	159,731,150
武蔵野銀行	11,000	2,730.000	30,030,000
千葉興業銀行	20,300	960.000	19,488,000
筑波銀行	36,200	241.000	8,724,200
七十七銀行	25,100	4,020.000	100,902,000
秋田銀行	5,200	2,210.000	11,492,000
山形銀行	9,700	1,040.000	10,088,000
岩手銀行	5,800	2,386.000	13,838,800
東邦銀行	65,400	249.000	16,284,600
東北銀行	4,600	1,173.000	5,395,800
ふくおかフィナンシャルグループ	74,500	3,747.000	279,151,500
スルガ銀行	72,500	1,169.000	84,752,500
八十二銀行	185,200	853.000	157,975,600
山梨中央銀行	9,100	1,637.000	14,896,700
大垣共立銀行	15,400	1,866.000	28,736,400
福井銀行	7,500	1,860.000	13,950,000
清水銀行	3,600	1,482.000	5,335,200
滋賀銀行	14,300	3,285.000	46,975,500
南都銀行	12,400	3,070.000	38,068,000
百五銀行	76,000	555.000	42,180,000
紀陽銀行	30,500	1,799.000	54,869,500
ほくほくフィナンシャルグループ	52,000	1,631.500	84,838,000
山陰合同銀行	53,100	1,250.000	66,375,000
鳥取銀行	3,900	1,260.000	4,914,000
百十四銀行	7,900	2,551.000	20,152,900
四国銀行	13,300	988.000	13,140,400
阿波銀行	12,000	2,496.000	29,952,000
大分銀行	5,100	3,215.000	16,396,500
宮崎銀行	5,200	2,740.000	14,248,000
佐賀銀行	5,100	2,082.000	10,618,200
琉球銀行	19,200	1,021.000	19,603,200
セブン銀行	270,400	283.800	76,739,520
みずほフィナンシャルグループ	1,163,400	2,832.000	3,294,748,800
山口フィナンシャルグループ	83,300	1,587.000	132,197,100
名古屋銀行	5,300	6,410.000	33,973,000
北洋銀行	129,900	398.000	51,700,200
大光銀行	5,300	1,429.000	7,573,700
愛媛銀行	11,600	1,180.000	13,688,000
トマト銀行	5,100	1,179.000	6,012,900
京葉銀行	37,400	731.000	27,339,400
栃木銀行	42,100	263.000	11,072,300
北日本銀行	2,600	2,456.000	6,385,600
東和銀行	15,200	587.000	8,922,400
大東銀行	8,500	657.000	5,584,500
トモニホールディングス	81,100	388.000	31,466,800



フィデアホールディングス	8,500	1,469.000	12,486,500
池田泉州ホールディングス	114,300	328.000	37,490,400
F P G	31,400	2,156.000	67,698,400
ジャパンインベストメントアドバイザー	14,800	1,112.000	16,457,600
マーキュリアホールディングス	2,700	854.000	2,305,800
S B Iホールディングス	137,600	3,234.000	444,998,400
ジャフコ グループ	26,500	2,040.000	54,060,000
大和証券グループ本社	666,100	1,012.500	674,426,250
野村ホールディングス	1,447,000	778.400	1,126,344,800
岡三証券グループ	74,900	626.000	46,887,400
丸三証券	29,100	971.000	28,256,100
東洋証券	27,400	403.000	11,042,200
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	95,600	493.000	47,130,800
水戸証券	25,200	418.000	10,533,600
いちよし証券	14,800	693.000	10,256,400
松井証券	47,400	806.000	38,204,400
マネックスグループ	85,200	614.000	52,312,800
極東証券	13,200	1,461.000	19,285,200
岩井コスモホールディングス	9,400	2,016.000	18,950,400
アイザワ証券グループ	13,600	1,801.000	24,493,600
スパークス・グループ	9,600	1,321.000	12,681,600
かんぽ生命保険	88,300	2,641.500	233,244,450
F P パートナー	3,800	2,738.000	10,404,400
S O M P Oホールディングス	388,900	3,251.000	1,264,313,900
アニコム ホールディングス	29,500	649.000	19,145,500
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	579,200	3,200.000	1,853,440,000
第一生命ホールディングス	405,300	3,752.000	1,520,685,600
東京海上ホールディングス	841,900	5,110.000	4,302,109,000
T & Dホールディングス	231,400	2,287.000	529,211,800
全国保証	22,600	5,670.000	128,142,000
ジェイリース	7,700	1,354.000	10,425,800
イントラスト	3,900	713.000	2,780,700
日本モーゲージサービス	10,100	407.000	4,110,700
S B I アルヒ	11,000	832.000	9,152,000
プレミアグループ	15,300	2,079.000	31,808,700
クレディセゾン	54,600	3,434.000	187,496,400
芙蓉総合リース	7,700	11,055.000	85,123,500
みずほリース	69,400	1,023.000	70,996,200
東京センチュリー	64,300	1,714.500	110,242,350
日本証券金融	32,000	1,893.000	60,576,000
アイフル	130,200	320.000	41,664,000
リコーリース	7,800	5,040.000	39,312,000
イオンフィナンシャルサービス	48,800	1,270.000	61,976,000
アコム	162,500	369.100	59,978,750
ジャックス	8,900	3,875.000	34,487,500
オリエントコーポレーション	26,800	942.000	25,245,600
オリックス	516,900	3,430.000	1,772,967,000

三菱HCキャピタル	379,800	1,041.500	395,561,700
九州リースサービス	4,800	1,017.000	4,881,600
日本取引所グループ	222,700	3,337.000	743,149,900
イー・ギャランティ	15,100	1,415.000	21,366,500
アサックス	2,900	749.000	2,172,100
NECキャピタルソリューション	3,900	3,810.000	14,859,000
Robot Home	32,000	144.000	4,608,000
大東建託	31,500	17,950.000	565,425,000
サムティホールディングス	10,100	2,618.000	26,441,800
いちご	100,700	360.000	36,252,000
日本駐車場開発	102,800	219.000	22,513,200
スター・マイカ・ホールディングス	11,000	614.000	6,754,000
SREホールディングス	4,000	4,405.000	17,620,000
ヒューリック	199,700	1,469.500	293,459,150
野村不動産ホールディングス	47,300	4,069.000	192,463,700
三重交通グループホールディングス	19,100	490.000	9,359,000
ディア・ライフ	14,200	908.000	12,893,600
地主	7,000	1,992.000	13,944,000
プレサンスコーポレーション	14,600	1,890.000	27,594,000
JPMC	4,500	1,111.000	4,999,500
フージャースホールディングス	12,200	1,032.000	12,590,400
オープンハウスグループ	31,500	5,673.000	178,699,500
東急不動産ホールディングス	255,500	997.700	254,912,350
飯田グループホールディングス	82,000	2,282.500	187,165,000
ムゲンエステート	4,200	1,485.000	6,237,000
And Doホールディングス	3,600	1,027.000	3,697,200
シーアールイー	5,300	1,383.000	7,329,900
ケイアイスター不動産	4,200	3,885.000	16,317,000
グッドコムアセット	8,900	841.000	7,484,900
ジェイ・エス・ビー	4,400	2,862.000	12,592,800
ロードスターキャピタル	5,900	2,252.000	13,286,800
霞ヶ関キャピタル	3,900	13,490.000	52,611,000
パーク24	66,900	1,774.000	118,680,600
パラカ	3,200	1,812.000	5,798,400
宮越ホールディングス	4,600	1,812.000	8,335,200
三井不動産	1,195,600	1,421.500	1,699,545,400
三菱地所	540,800	2,325.000	1,257,360,000
平和不動産	13,900	4,010.000	55,739,000
東京建物	73,900	2,319.000	171,374,100
京阪神ビルディング	19,700	1,559.000	30,712,300
住友不動産	124,400	4,760.000	592,144,000
テーオーシー	18,100	621.000	11,240,100
レオパレス21	88,100	596.000	52,507,600
スターツコーポレーション	12,500	3,345.000	41,812,500
フジ住宅	10,800	681.000	7,354,800
空港施設	12,000	577.000	6,924,000
明和地所	6,200	969.000	6,007,800
ゴールドクレスト	8,200	3,200.000	26,240,000

エスリード	3,800	4,540.000	17,252,000
日神グループホールディングス	15,200	488.000	7,417,600
日本エスコン	16,700	1,002.000	16,733,400
M I R A R T Hホールディングス	48,900	502.000	24,547,800
イオンモール	44,100	2,078.500	91,661,850
毎日コムネット	6,300	705.000	4,441,500
カチタス	23,600	1,750.000	41,300,000
トーセイ	14,500	2,272.000	32,944,000
穴吹興産	2,700	2,025.000	5,467,500
サンフロンティア不動産	13,000	1,714.000	22,282,000
F Jネクストホールディングス	8,800	1,276.000	11,228,800
日本空港ビルディング	30,500	5,046.000	153,903,000
L I F U L L	36,500	140.000	5,110,000
M I X I	19,500	2,862.000	55,809,000
ジェイエイシーリクルートメント	32,000	790.000	25,280,000
日本M & Aセンターホールディングス	142,700	638.400	91,099,680
メンバーズ	4,400	896.000	3,942,400
U Tグループ	11,900	2,697.000	32,094,300
アイティメディア	3,600	1,636.000	5,889,600
ケアネット	18,100	638.000	11,547,800
E・Jホールディングス	5,400	1,715.000	9,261,000
オープンアップグループ	26,800	2,037.000	54,591,600
コシダカホールディングス	27,700	975.000	27,007,500
アルトナー	2,000	1,857.000	3,714,000
パソナグループ	11,000	2,203.000	24,233,000
リンクアンドモチベーション	26,700	601.000	16,046,700
エス・エム・エス	31,900	2,132.500	68,026,750
パーソルホールディングス	911,300	281.000	256,075,300
リニカル	5,500	398.000	2,189,000
学情	4,700	1,628.000	7,651,600
スタジオアリス	4,800	2,056.000	9,868,800
N J S	2,000	3,515.000	7,030,000
総合警備保障	147,300	1,060.000	156,138,000
カカクコム	57,700	2,590.000	149,443,000
セントケア・ホールディング	7,500	736.000	5,520,000
ルネサンス	6,700	1,058.000	7,088,600
ディップ	13,900	2,845.000	39,545,500
デジタルホールディングス	6,000	945.000	5,670,000
新日本科学	8,700	1,142.000	9,935,400
エムスリー	172,800	1,346.500	232,675,200
ウェルネット	4,000	828.000	3,312,000
ワールドホールディングス	4,200	1,913.000	8,034,600
ディー・エヌ・エー	31,300	1,643.000	51,425,900
博報堂D Yホールディングス	115,000	1,228.000	141,220,000
ぐるなび	16,000	367.000	5,872,000
タカミヤ	13,200	456.000	6,019,200
ファンコミュニケーションズ	15,000	400.000	6,000,000
ライク	3,800	1,435.000	5,453,000

エスプール	30,200	360.000	10,872,000
W D Bホールディングス	4,500	1,736.000	7,812,000
アドウェイズ	14,300	354.000	5,062,200
バリューコマース	8,700	1,099.000	9,561,300
インフォマート	94,600	328.000	31,028,800
J Pホールディングス	26,200	720.000	18,864,000
プレステージ・インターナショナル	43,300	746.000	32,301,800
アミューズ	5,300	1,413.000	7,488,900
ドリームインキュベータ	3,200	2,257.000	7,222,400
クイック	5,900	2,060.000	12,154,000
電通グループ	97,000	4,261.000	413,317,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,500	865.000	3,892,500
ぴあ	3,100	3,020.000	9,362,000
イオンファンタジー	3,600	2,237.000	8,053,200
シーティーエス	10,600	830.000	8,798,000
H . U . グループホールディングス	25,200	2,610.500	65,784,600
アルプス技研	8,200	2,735.000	22,427,000
日本空調サービス	10,200	1,075.000	10,965,000
オリエンタルランド	476,200	3,935.000	1,873,847,000
ダスキン	18,600	3,959.000	73,637,400
明光ネットワークジャパン	13,800	686.000	9,466,800
ファルコホールディングス	4,900	2,359.000	11,559,100
ラウンドワン	83,400	983.000	81,982,200
リゾートトラスト	39,000	2,890.500	112,729,500
ビー・エム・エル	11,500	2,686.000	30,889,000
リソー教育	50,900	246.000	12,521,400
早稲田アカデミー	5,500	1,570.000	8,635,000
ユー・エス・エス	200,300	1,386.500	277,715,950
東京個別指導学院	19,000	405.000	7,695,000
サイバーエージェント	198,400	1,042.000	206,732,800
楽天グループ	635,300	947.700	602,073,810
クリーク・アンド・リバー社	5,100	1,446.000	7,374,600
S B I グローバルアセットマネジメント	18,000	597.000	10,746,000
テー・オー・ダブリュー	23,800	315.000	7,497,000
山田コンサルティンググループ	4,300	2,332.000	10,027,600
セントラルスポーツ	3,700	2,499.000	9,246,300
フルキャストホールディングス	8,800	1,560.000	13,728,000
エン・ジャパン	15,200	2,455.000	37,316,000
テクノプロ・ホールディングス	52,000	2,958.000	153,816,000
アイ・アールジャパンホールディングス	5,400	922.000	4,978,800
K e e P e r 技研	5,700	4,040.000	23,028,000
G u n o s y	9,200	891.000	8,197,200
イー・ガーディアン	4,300	1,856.000	7,980,800
ジャパンマテリアル	27,200	1,661.000	45,179,200
ベクトル	11,700	916.000	10,717,200
チャーム・ケア・コーポレーション	7,900	1,385.000	10,941,500
キャリアリンク	3,600	2,521.000	9,075,600
I B J	8,600	693.000	5,959,800

アサンテ	5,200	1,664.000	8,652,800
バリューHR	8,000	1,598.000	12,784,000
M&Aキャピタルパートナーズ	7,700	2,170.000	16,709,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,200	1,001.000	6,206,200
E R Iホールディングス	1,000	1,977.000	1,977,000
シグマクス・ホールディングス	12,300	1,490.000	18,327,000
ウィルグループ	7,000	928.000	6,496,000
メドピア	9,400	603.000	5,668,200
リクルートホールディングス	648,400	8,522.000	5,525,664,800
エラン	12,000	840.000	10,080,000
日本郵政	939,100	1,401.500	1,316,148,650
ベルシステム24ホールディングス	11,300	1,543.000	17,435,900
鎌倉新書	9,900	404.000	3,999,600
エアトリ	7,200	1,190.000	8,568,000
アトラエ	7,800	784.000	6,115,200
ストライク	4,200	4,610.000	19,362,000
ソラスト	25,400	564.000	14,325,600
セラク	2,500	1,383.000	3,457,500
インソース	20,100	1,072.000	21,547,200
ベйкаレント	66,300	4,830.000	320,229,000
Orchestra Holdings	2,500	856.000	2,140,000
アイモバイル	14,100	461.000	6,500,100
MS - Japan	4,000	1,001.000	4,004,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	29,000	2,808.000	81,432,000
グリーンズ	1,200	1,725.000	2,070,000
エル・ティー・エス	1,300	1,639.000	2,130,700
ミダックホールディングス	5,700	1,668.000	9,507,600
キュービーネットホールディングス	5,900	1,081.000	6,377,900
オープングループ	16,600	204.000	3,386,400
マネジメントソリューションズ	4,300	1,189.000	5,112,700
フロンティア・マネジメント	2,600	1,143.000	2,971,800
コプロ・ホールディングス	1,600	1,530.000	2,448,000
アンビスホールディングス	19,400	1,808.000	35,075,200
カーブスホールディングス	24,400	767.000	18,714,800
フォーラムエンジニアリング	13,000	989.000	12,857,000
FAST FITNESS JAPAN	3,800	1,267.000	4,814,600
ダイレクトマーケティングミックス	13,800	257.000	3,546,600
ポピンズ	1,600	1,474.000	2,358,400
LITALICO	7,200	1,233.000	8,877,600
リログループ	44,700	1,831.500	81,868,050
東祥	6,000	691.000	4,146,000
ID&E ホールディングス	5,600	3,970.000	22,232,000
ビーウィズ	2,400	1,813.000	4,351,200
サンウェルズ	5,100	2,010.000	10,251,000
TREホールディングス	17,900	1,582.000	28,317,800
人・夢・技術グループ	3,600	1,751.000	6,303,600
NISSOホールディングス	9,000	754.000	6,786,000

大栄環境	16,400	3,130.000	51,332,000
日本管財ホールディングス	8,900	2,632.000	23,424,800
M & A 総研ホールディングス	9,700	2,935.000	28,469,500
エイチ・アイ・エス	28,100	1,835.000	51,563,500
共立メンテナンス	28,600	2,278.000	65,150,800
イチネンホールディングス	9,100	1,752.000	15,943,200
建設技術研究所	4,600	4,425.000	20,355,000
スペース	7,100	1,081.000	7,675,100
燦ホールディングス	8,500	1,163.000	9,885,500
スバル興業	3,200	2,869.000	9,180,800
東京テアトル	7,000	1,101.000	7,707,000
ナガワ	2,900	7,220.000	20,938,000
東京都競馬	7,600	3,930.000	29,868,000
カナモト	14,400	2,944.000	42,393,600
ニシオホールディングス	8,300	4,130.000	34,279,000
トランス・コスモス	11,300	3,480.000	39,324,000
乃村工藝社	40,100	819.000	32,841,900
藤田観光	4,000	9,430.000	37,720,000
KNT - CTホールディングス	6,100	1,281.000	7,814,100
トーカイ	7,600	2,185.000	16,606,000
セコム	91,000	10,990.000	1,000,090,000
セントラル警備保障	5,000	2,681.000	13,405,000
丹青社	18,200	869.000	15,815,800
メイテックグループホールディングス	29,600	3,386.000	100,225,600
応用地質	8,700	2,463.000	21,428,100
船井総研ホールディングス	18,500	2,269.000	41,976,500
いであ	700	2,240.000	1,568,000
学究社	4,200	2,007.000	8,429,400
イオンディライト	9,700	4,215.000	40,885,500
ダイセキ	18,100	3,705.000	67,060,500
ステップ	3,200	1,973.000	6,313,600
合 計	142,796,700		317,631,995,360

## (b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

## 外国株式インデックス・マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位：円)

(2024年9月10日現在)

## 資産の部

## 流動資産

預金

3,979,584,829

金銭信託

2,323,696

コール・ローン

431,792,854

株式	752,311,651,520
投資証券	16,422,882,343
派生商品評価勘定	6,366,930
未収入金	8,084,237
未収配当金	1,114,163,944
差入委託証拠金	3,292,441,312
流動資産合計	777,569,291,665
資産合計	777,569,291,665
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	186,691,500
未払解約金	142,288,955
流動負債合計	328,980,455
負債合計	328,980,455
純資産の部	
元本等	
元本	88,896,330,594
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	688,343,980,616
元本等合計	777,240,311,210
純資産合計	777,240,311,210
負債純資産合計	777,569,291,665

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2023年9月12日 至 2024年9月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、新株予約権証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## (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9月10日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	88,896,330,594口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 8.7432円 (1万口当たりの純資産額87,432円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項 目	自 2023年9月12日 至 2024年9月10日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、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。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>



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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2024年9月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（株式、新株予約権証券、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2024年9月10日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	S&P 500 EMINI FUT SEP24	6,800,155,369	-	6,645,693,766	154,461,603
	SPI 200 FUTURES SEP24	246,800,293	-	247,084,256	283,963
	FTSE 100 IDX FUT SEP24	344,311,098	-	341,545,178	2,765,920
	EURO STOXX 50 SEP24	1,174,930,514	-	1,150,843,771	24,086,743
	小計	8,566,197,274	-	8,385,166,971	181,030,303
	合計	8,566,197,274	-	8,385,166,971	181,030,303

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	121,588,153	-	122,251,776	663,623
	ユーロ	59,636,235	-	59,678,346	42,111
	小計	181,224,388	-	181,930,122	705,734
合計	181,224,388	-	181,930,122	705,734	

## (注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2023年9月12日 至 2024年9月10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9月10日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	80,285,355,686円
同期中における追加設定元本額	16,938,544,135円
同期中における一部解約元本額	8,327,569,227円
2024年9月10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	45,043,069,233円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	247,135,379円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	956,054,621円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	766,986,589円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	39,440,707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)	679,815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)	2,679,721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)	11,113,114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)	33,803,961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)	42,254,871円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	95,689,898円
外国株式指数ファンド	1,202,756,985円
三井住友・DCつみたてN I S A・全海外株インデックスファンド	24,064,311,560円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	23,754,138円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	67,345,056円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	40,858,189円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	32,811,661円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	155,974,068円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	144,910,320円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	580,758,161円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	362,014,725円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	521,624,535円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	68,713,448円
三井住友D S・外国株式インデックス年金ファンド	3,103,778,305円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	11,128,354円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	57,165,915円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	61,028,838円

三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2060	4,531,299円
S M B C ・ D C インデックスファンド ( M S C I コクサイ )	2,161,233,163円
日興F W S ・ 先進国株インデックス ( 為替ヘッジあり )	166,336,325円
日興F W S ・ 先進国株インデックス ( 為替ヘッジなし )	3,635,292,026円
三井住友D S ・ 先進国株式インデックス・ファンド	167,260,173円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2035	9,066,046円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2040	5,964,526円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2045	6,701,131円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2055	3,665,061円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2065	2,225,381円
三井住友D S ・ F W 専用ポートフォリオ・レベル1 ( 保守型 )	175,874円
三井住友D S ・ F W 専用ポートフォリオ・レベル2 ( 安定型 )	4,850,168円
三井住友D S ・ F W 専用ポートフォリオ・レベル3 ( 安定成長型 )	25,076,985円
三井住友D S ・ F W 専用ポートフォリオ・レベル4 ( 成長型 )	26,706,101円
三井住友D S ・ F W 専用ポートフォリオ・レベル5 ( 積極成長型 )	10,184,502円
S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファンド ( 適格機関投資家専用 )	237,367,207円
バランスファンドV A ( 安定運用型 ) < 適格機関投資家限定 >	1,613,985円
S M A M ・ バランスファンドV A 安定成長型 < 適格機関投資家限定 >	8,507,417円
S M A M ・ バランスファンドV A 25 < 適格機関投資家専用 >	244,424,936円
S M A M ・ バランスファンドV A 37.5 < 適格機関投資家専用 >	451,986,789円
S M A M ・ バランスファンドV A 50 < 適格機関投資家専用 >	2,044,178,308円
S M A M ・ バランスファンドV L 30 < 適格機関投資家限定 >	6,385,797円
S M A M ・ バランスファンドV L 50 < 適格機関投資家限定 >	32,476,182円
S M A M ・ バランスファンドV A 75 < 適格機関投資家専用 >	336,238,658円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	23,753,768円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 25 < 適格機関投資家専用 >	54,210,390円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 50 < 適格機関投資家専用 >	286,136,389円
S M A M ・ バランスファンドV A 40 < 適格機関投資家専用 >	183,205,513円
S M A M ・ バランスファンドV A 35 < 適格機関投資家専用 >	404,330,166円
三井住友・外国株式インデックスファンド・V A S ( 適格機関投資家専用 )	163,340,053円
S M A M ・ グローバルバランス40V A < 適格機関投資家限定 >	35,586,512円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 20A < 適格機関投資家専用 >	4,094,878円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 35A < 適格機関投資家専用 >	3,762,642円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 50A < 適格機関投資家専用 >	3,045,479円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 20L < 適格機関投資家専用 >	9,255,993円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 25L < 適格機関投資家専用 >	31,912,804円
S M A M ・ グローバルバランスファンド ( 標準型 ) V A < 適格機関投資家限定 >	68,971,315円
S M A M ・ グローバルバランスファンド ( 債券重視型 ) V A < 適格機関投資家限定 >	28,947,304円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	111,684,257円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	41,477,177円
S M A M ・ 外国株式インデックスファンドS A < 適格機関投資家限定 >	20,452,057円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	17,673,700円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016 - 04 < 適格機関投資家限定 >	11,287,097円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	18,145,014円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	12,599,975円

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

定&gt;

32,167,904円

合計

88,896,330,594円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	APA CORP	27,608	24.920	687,991.36	
	BAKER HUGHES CO	87,866	33.690	2,960,205.54	
	CHENIERE ENERGY INC	19,829	178.490	3,539,278.21	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	7,695	70.310	541,035.45	
	CHEVRON CORP	150,477	140.300	21,111,923.10	
	CHORD ENERGY CORP	5,159	133.110	686,714.49	
	CONOCOPHILLIPS	97,908	105.600	10,339,084.80	
	COTERRA ENERGY INC	59,741	22.800	1,362,094.80	
	DEVON ENERGY CORP	49,897	41.400	2,065,735.80	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	14,567	179.210	2,610,552.07	
	EOG RESOURCES INC	50,302	120.500	6,061,391.00	
	EQT CORP	47,708	31.910	1,522,362.28	
	EXXON MOBIL CORP	384,075	115.010	44,172,465.75	
	HALLIBURTON CO	76,654	28.680	2,198,436.72	
	HESS CORP	23,450	128.880	3,022,236.00	
	HF SINCLAIR CORP	10,663	45.630	486,552.69	
	KINDER MORGAN INC	173,893	21.120	3,672,620.16	
	MARATHON OIL CORP	53,220	26.630	1,417,248.60	
	MARATHON PETROLEUM CORP	30,431	163.250	4,967,860.75	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	57,692	52.180	3,010,368.56	
	ONEOK INC	47,832	92.040	4,402,457.28	
	OVINTIV INC	23,075	40.290	929,691.75	
	PHILLIPS 66	36,059	127.970	4,614,470.23	
	SCHLUMBERGER LTD	121,500	40.410	4,909,815.00	
	TARGA RESOURCES CORP	18,523	143.930	2,666,015.39	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	1,661	791.520	1,314,714.72	
	VALERO ENERGY CORP	27,819	134.160	3,732,197.04	
	WILLIAMS COS INC	104,963	44.520	4,672,952.76	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	18,963	273.820	5,192,448.66	
	ALBEMARLE CORP	8,338	78.410	653,782.58	
	AMCOR PLC	122,899	11.100	1,364,178.90	
	AVERY DENNISON CORP	6,759	219.580	1,484,141.22	
BALL CORP	28,423	64.290	1,827,314.67		
CELANESE CORP	8,742	120.360	1,052,187.12		
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	14,020	78.470	1,100,149.40		

CORTEVA INC	60,038	55.800	3,350,120.40	
CRH PLC	58,997	84.300	4,973,447.10	
CROWN HOLDINGS INC	9,413	90.900	855,641.70	
DOW INC	59,685	51.300	3,061,840.50	
DUPONT DE NEMOURS INC	36,397	79.560	2,895,745.32	
EASTMAN CHEMICAL CO	9,517	98.010	932,761.17	
ECOLAB INC	21,611	249.190	5,385,245.09	
FREEMONT-MCMORAN INC	121,991	40.400	4,928,436.40	
INTERNATIONAL PAPER CO	29,910	47.610	1,424,015.10	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	20,983	103.460	2,170,901.18	
LINDE PLC	40,847	463.080	18,915,428.76	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	22,165	94.780	2,100,798.70	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,394	506.180	2,730,334.92	
MOSAIC CO/THE	25,489	25.060	638,754.34	
NEWMONT CORP	101,538	50.720	5,150,007.36	
NUCOR CORP	20,787	140.920	2,929,304.04	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,111	204.530	1,454,412.83	
PPG INDUSTRIES INC	21,291	126.140	2,685,646.74	
RELIANCE INC	5,040	272.370	1,372,744.80	
RPM INTERNATIONAL INC	10,397	117.360	1,220,191.92	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	20,286	363.900	7,382,075.40	
SMURFIT WESTROCK PLC	47,029	44.470	2,091,379.63	
STEEL DYNAMICS INC	12,713	110.740	1,407,837.62	
VULCAN MATERIALS CO	11,015	231.830	2,553,607.45	
WESTLAKE CORP	4,430	137.510	609,169.30	
3M CO	46,568	128.460	5,982,125.28	
AECOM	10,261	94.440	969,048.84	
AERCAP HOLDINGS NV	18,294	91.250	1,669,327.50	
ALLEGION PLC	6,843	134.560	920,794.08	
AMETEK INC	20,578	164.300	3,380,965.40	
AXON ENTERPRISE INC	5,927	364.390	2,159,739.53	
BOEING CO/THE	50,840	162.910	8,282,344.40	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	9,801	166.160	1,628,534.16	
CARLISLE COS INC	4,354	395.080	1,720,178.32	
CARRIER GLOBAL CORP	66,639	70.730	4,713,376.47	
CATERPILLAR INC	41,903	334.040	13,997,278.12	
CNH INDUSTRIAL NV	87,561	10.520	921,141.72	
CUMMINS INC	11,429	296.810	3,392,241.49	
DEERE & CO	22,561	387.230	8,736,296.03	
DOVER CORP	12,242	178.890	2,189,971.38	
EATON CORP PLC	33,582	289.380	9,717,959.16	
EMCOR GROUP INC	4,293	364.100	1,563,081.30	
EMERSON ELECTRIC CO	48,843	99.580	4,863,785.94	
FASTENAL CO	47,002	68.090	3,200,366.18	

FERGUSON ENTERPRISES INC	18,035	185.870	3,352,165.45	
FORTIVE CORP	29,388	72.310	2,125,046.28	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	10,648	77.910	829,585.68	
GE AEROSPACE	93,374	165.350	15,439,390.90	
GE VERNOVA INC	24,156	201.810	4,874,922.36	
GENERAL DYNAMICS CORP	19,558	301.560	5,897,910.48	
GRACO INC	15,068	81.380	1,226,233.84	
HEICO CORP	3,085	255.640	788,649.40	
HEICO CORP-CLASS A	6,593	198.920	1,311,479.56	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	56,350	201.160	11,335,366.00	
HOWMET AEROSPACE INC	33,070	93.690	3,098,328.30	
HUBBELL INC	4,737	378.120	1,791,154.44	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,888	267.740	773,233.12	
IDEX CORP	6,048	197.170	1,192,484.16	
ILLINOIS TOOL WORKS	26,116	246.740	6,443,861.84	
INGERSOLL-RAND INC	33,421	87.450	2,922,666.45	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	11,600	36.980	428,968.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	57,700	68.600	3,958,220.00	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	15,814	229.270	3,625,675.78	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,750	555.070	1,526,442.50	
LOCKHEED MARTIN CORP	18,178	576.570	10,480,889.46	
MASCO CORP	19,187	77.320	1,483,538.84	
NORDSON CORP	5,282	247.360	1,306,555.52	
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,313	524.210	6,454,597.73	
OTIS WORLDWIDE CORP	35,270	91.680	3,233,553.60	
OWENS CORNING	7,597	156.550	1,189,310.35	
PACCAR INC	43,068	94.970	4,090,167.96	
PARKER HANNIFIN CORP	10,784	580.200	6,256,876.80	
PENTAIR PLC	15,664	86.520	1,355,249.28	
QUANTA SERVICES INC	13,102	250.060	3,276,286.12	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,863	259.250	2,556,982.75	
RTX CORP	114,772	121.160	13,905,775.52	
SMITH (A.O.) CORP	10,652	77.890	829,684.28	
SNAP-ON INC	4,041	277.020	1,119,437.82	
STANLEY BLACK & DECKER INC	12,917	96.190	1,242,486.23	
TEXTRON INC	14,870	86.880	1,291,905.60	
TORO CO	8,097	82.640	669,136.08	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	19,070	345.300	6,584,871.00	
TRANSDIGM GROUP INC	4,733	1,302.770	6,166,010.41	
UNITED RENTALS INC	5,643	695.940	3,927,189.42	
VERTIV HOLDINGS CO-A	32,504	74.480	2,420,897.92	
WABTEC CORP	15,150	162.720	2,465,208.00	
WATSCO INC	3,112	455.580	1,417,764.96	
WW GRAINGER INC	3,717	972.140	3,613,444.38	

XYLEM INC	19,463	129.310	2,516,760.53	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	34,745	275.590	9,575,374.55	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	10,637	151.960	1,616,398.52	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	10,783	210.650	2,271,438.95	
CINTAS CORP	7,902	804.720	6,358,897.44	
COPART INC	72,947	49.420	3,605,040.74	
DAYFORCE INC	10,485	56.810	595,652.85	
EQUIFAX INC	10,373	297.390	3,084,826.47	
JACOBS SOLUTIONS INC	10,393	144.540	1,502,204.22	
LEIDOS HOLDINGS INC	11,403	153.460	1,749,904.38	
PAYCHEX INC	27,578	132.220	3,646,363.16	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,778	163.820	618,911.96	
REPUBLIC SERVICES INC	19,598	205.300	4,023,469.40	
ROLLINS INC	25,137	49.660	1,248,303.42	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,314	72.720	1,404,514.08	
TRANSUNION	18,291	96.510	1,765,264.41	
VERALTO CORP	22,013	109.490	2,410,203.37	
VERISK ANALYTICS INC	12,690	273.250	3,467,542.50	
WASTE CONNECTIONS INC	22,344	185.000	4,133,640.00	
WASTE MANAGEMENT INC	33,524	208.460	6,988,413.04	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,726	101.070	881,936.82	
CSX CORP	165,227	33.760	5,578,063.52	
DELTA AIR LINES INC	14,192	43.680	619,906.56	
EXPEDITORS INTL WASH INC	13,237	122.530	1,621,929.61	
FEDEX CORP	19,408	283.300	5,498,286.40	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	216,253	3.350	724,447.55	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	6,308	171.740	1,083,335.92	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	12,089	51.340	620,649.26	
NORFOLK SOUTHERN CORP	19,928	256.810	5,117,709.68	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	16,449	189.780	3,121,691.22	
SOUTHWEST AIRLINES CO	14,057	29.730	417,914.61	
UBER TECHNOLOGIES INC	157,907	69.800	11,021,908.60	
U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING	5,850	66.130	386,860.50	
UNION PACIFIC CORP	52,696	251.110	13,232,492.56	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	61,570	128.880	7,935,141.60	
APTIV PLC	23,575	69.080	1,628,561.00	
FORD MOTOR CO	325,996	10.660	3,475,117.36	
GENERAL MOTORS CO	99,425	47.400	4,712,745.00	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	72,072	13.080	942,701.76	
TESLA INC	245,643	216.270	53,125,211.61	
DECKERS OUTDOOR CORP	2,220	894.090	1,984,879.80	
DR HORTON INC	26,159	187.520	4,905,335.68	
GARMIN LTD	13,282	182.940	2,429,809.08	
LENNAR CORP-A	21,335	180.200	3,844,567.00	



LULULEMON ATHLETICA INC	10,287	248.585	2,557,193.89	
NIKE INC -CL B	102,257	79.490	8,128,408.93	
NVR INC	250	9,149.740	2,287,435.00	
PULTEGROUP INC	17,535	131.600	2,307,606.00	
AIRBNB INC-CLASS A	38,522	116.360	4,482,419.92	
BOOKING HOLDINGS INC	2,870	3,802.890	10,914,294.30	
CARNIVAL CORP	84,815	16.030	1,359,584.45	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	117,100	54.290	6,357,359.00	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,323	156.710	1,461,007.33	
DOMINO'S PIZZA INC	2,875	420.160	1,207,960.00	
DOORDASH INC - A	24,823	124.610	3,093,194.03	
DRAFTKINGS INC-CL A	32,265	36.110	1,165,089.15	
EXPEDIA GROUP INC	10,081	132.860	1,339,361.66	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	15,951	219.300	3,498,054.30	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	21,638	214.940	4,650,871.72	
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,371	145.800	491,491.80	
LAS VEGAS SANDS CORP	27,977	40.000	1,119,080.00	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	20,953	228.590	4,789,646.27	
MCDONALD'S CORP	61,103	291.290	17,798,692.87	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,198	34.970	776,264.06	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	21,669	160.260	3,472,673.94	
STARBUCKS CORP	95,086	92.210	8,767,880.06	
WYNN RESORTS LTD	7,730	76.910	594,514.30	
YUM! BRANDS INC	25,236	133.040	3,357,397.44	
AMAZON.COM INC	799,908	175.400	140,303,863.20	
AUTOZONE INC	1,423	3,120.500	4,440,471.50	
BATH & BODY WORKS INC	15,400	27.540	424,116.00	
BEST BUY CO INC	19,353	98.090	1,898,335.77	
BURLINGTON STORES INC	6,047	262.930	1,589,937.71	
CARMAX INC	14,212	80.630	1,145,913.56	
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,406	207.430	913,936.58	
EBAY INC	40,534	59.430	2,408,935.62	
GENUINE PARTS CO	12,304	136.610	1,680,849.44	
GLOBAL-E ONLINE LTD	7,348	34.440	253,065.12	
HOME DEPOT INC	85,029	365.520	31,079,800.08	
LKQ CORP	24,732	39.980	988,785.36	
LOWE'S COS INC	48,054	244.730	11,760,255.42	
MERCADOLIBRE INC	3,878	2,029.910	7,871,990.98	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,881	1,124.020	5,486,341.62	
POOL CORP	3,252	346.480	1,126,752.96	
ROSS STORES INC	29,519	150.790	4,451,170.01	
TJX COMPANIES INC	95,580	117.070	11,189,550.60	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	9,377	272.790	2,557,951.83	
ULTA BEAUTY INC	3,734	381.570	1,424,782.38	

WILLIAMS-SONOMA INC	10,952	132.330	1,449,278.16	
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	31,907	17.940	572,411.58	
COSTCO WHOLESALE CORP	38,003	896.490	34,069,309.47	
DOLLAR GENERAL CORP	18,277	80.980	1,480,071.46	
DOLLAR TREE INC	15,923	67.420	1,073,528.66	
KROGER CO	56,767	51.970	2,950,180.99	
SYSCO CORP	44,624	78.410	3,498,967.84	
TARGET CORP	38,491	150.590	5,796,359.69	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	52,808	8.910	470,519.28	
WALMART INC	379,538	77.340	29,353,468.92	
ALTRIA GROUP INC	143,314	54.130	7,757,586.82	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	42,289	59.500	2,516,195.50	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	18,548	46.340	859,514.32	
BUNGE GLOBAL SA	12,343	98.920	1,220,969.56	
CAMPBELL SOUP CO	12,945	51.740	669,774.30	
CELSIUS HOLDINGS INC	11,375	33.390	379,811.25	
COCA-COLA CO/THE	351,399	71.850	25,248,018.15	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	18,105	81.540	1,476,281.70	
CONAGRA BRANDS INC	39,722	32.830	1,304,073.26	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	13,962	250.890	3,502,926.18	
GENERAL MILLS INC	46,029	75.150	3,459,079.35	
HERSHEY CO/THE	12,733	203.250	2,587,982.25	
HORMEL FOODS CORP	25,536	32.400	827,366.40	
JM SMUCKER CO/THE	8,172	120.180	982,110.96	
KELLANOVA	25,249	80.170	2,024,212.33	
KEURIG DR PEPPER INC	93,410	37.270	3,481,390.70	
KRAFT HEINZ CO/THE	82,333	36.050	2,968,104.65	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	10,534	63.170	665,432.78	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	22,009	83.240	1,832,029.16	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	16,433	55.940	919,262.02	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	113,082	75.710	8,561,438.22	
MONSTER BEVERAGE CORP	63,778	50.740	3,236,095.72	
PEPSICO INC	118,115	178.190	21,046,911.85	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	133,950	127.450	17,071,927.50	
TYSON FOODS INC-CL A	25,497	65.780	1,677,192.66	
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,954	105.600	2,107,142.40	
CLOROX COMPANY	10,423	165.200	1,721,879.60	
COLGATE-PALMOLIVE CO	65,674	107.110	7,034,342.14	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	19,241	86.910	1,672,235.31	
KENVUE INC	158,991	23.200	3,688,591.20	
KIMBERLY-CLARK CORP	28,172	147.180	4,146,354.96	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	202,313	176.060	35,619,226.78	
ABBOTT LABORATORIES	149,852	116.430	17,447,268.36	
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,703	221.380	1,262,530.14	

BAXTER INTERNATIONAL INC	39,241	39.230	1,539,424.43	
BECTON DICKINSON AND CO	24,215	237.220	5,744,282.30	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	124,087	82.650	10,255,790.55	
CARDINAL HEALTH INC	20,986	112.800	2,367,220.80	
CENCORA INC	15,601	236.530	3,690,104.53	
CENTENE CORP	44,436	70.840	3,147,846.24	
COOPER COS INC/THE	17,340	108.030	1,873,240.20	
CVS HEALTH CORP	104,686	56.470	5,911,618.42	
DAVITA INC	4,138	150.240	621,693.12	
DEXCOM INC	33,202	69.710	2,314,511.42	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	51,676	65.710	3,395,629.96	
ELEVANCE HEALTH INC	20,124	543.660	10,940,613.84	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	35,095	85.120	2,987,286.40	
HCA HEALTHCARE INC	16,659	384.950	6,412,882.05	
HENRY SCHEIN INC	10,457	68.890	720,382.73	
HOLOGIC INC	19,730	82.690	1,631,473.70	
HUMANA INC	10,475	343.760	3,600,886.00	
IDEXX LABORATORIES INC	7,376	480.340	3,542,987.84	
INSULET CORP	5,082	219.130	1,113,618.66	
INTUITIVE SURGICAL INC	30,598	479.390	14,668,375.22	
LABCORP HOLDINGS INC	7,903	226.910	1,793,269.73	
MCKESSON CORP	10,903	509.420	5,554,206.26	
MEDTRONIC PLC	110,600	90.620	10,022,572.00	
MOLINA HEALTHCARE INC	4,673	323.720	1,512,743.56	
QUEST DIAGNOSTICS INC	9,647	154.290	1,488,435.63	
RESMED INC	12,536	249.560	3,128,484.16	
SOLVENTUM CORP	10,620	67.030	711,858.60	
STERIS PLC	9,126	245.500	2,240,433.00	
STRYKER CORP	29,004	362.780	10,522,071.12	
TELEFLEX INC	3,952	245.040	968,398.08	
THE CIGNA GROUP	23,734	357.610	8,487,515.74	
UNITEDHEALTH GROUP INC	78,512	594.100	46,643,979.20	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	5,785	226.510	1,310,360.35	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12,279	222.590	2,733,182.61	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	18,219	104.830	1,909,897.77	
ABBVIE INC	150,635	196.420	29,587,726.70	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	25,379	138.090	3,504,586.11	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	11,014	253.160	2,788,304.24	
AMGEN INC	46,259	325.920	15,076,733.28	
AVANTOR INC	56,039	25.800	1,445,806.20	
BIOGEN INC	12,779	199.270	2,546,471.33	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	18,017	84.330	1,519,373.61	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,728	323.090	558,299.52	
BIO-TECHNE CORP	13,296	72.090	958,508.64	

BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	170,214	48.500	8,255,379.00	
CATALENT INC	16,025	59.910	960,057.75	
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,795	188.160	902,227.20	
DANAHER CORP	57,483	273.090	15,698,032.47	
ELI LILLY & CO	68,957	908.270	62,631,574.39	
EXACT SCIENCES CORP	13,570	58.790	797,780.30	
GILEAD SCIENCES INC	104,725	79.170	8,291,078.25	
ILLUMINA INC	14,966	122.540	1,833,933.64	
INCYTE CORP	15,899	62.260	989,871.74	
IQVIA HOLDINGS INC	15,286	240.870	3,681,938.82	
JOHNSON & JOHNSON	205,298	166.610	34,204,699.78	
MERCK & CO. INC.	216,057	115.410	24,935,138.37	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,813	1,384.770	2,510,588.01	
MODERNA INC	27,369	76.610	2,096,739.09	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,744	120.640	1,054,876.16	
PFIZER INC	489,096	29.410	14,384,313.36	
REGENERON PHARMACEUTICALS	9,121	1,144.770	10,441,447.17	
REVVITY INC	10,411	118.760	1,236,410.36	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	27,162	28.110	763,523.82	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	102,259	17.800	1,820,210.20	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	32,830	620.420	20,368,388.60	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,537	348.710	1,233,387.27	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	21,794	471.110	10,267,371.34	
VIATRIS INC	99,736	11.130	1,110,061.68	
WATERS CORP	5,084	332.100	1,688,396.40	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	6,204	302.030	1,873,794.12	
ZOETIS INC	38,410	191.730	7,364,349.30	
BANK OF AMERICA CORP	596,414	39.470	23,540,460.58	
CITIGROUP INC	160,852	59.540	9,577,128.08	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	36,122	41.450	1,497,256.90	
FIFTH THIRD BANCORP	58,586	41.600	2,437,177.60	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	845	1,900.680	1,606,074.60	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	128,600	14.660	1,885,276.00	
JPMORGAN CHASE & CO	245,020	216.810	53,122,786.20	
KEYCORP	84,828	16.180	1,372,517.04	
M & T BANK CORP	14,423	168.780	2,434,313.94	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	34,855	182.610	6,364,871.55	
REGIONS FINANCIAL CORP	79,089	22.550	1,783,456.95	
TRUIST FINANCIAL CORP	110,627	42.600	4,712,710.20	
US BANCORP	129,406	45.260	5,856,915.56	
WELLS FARGO & CO	297,335	54.590	16,231,517.65	
ALLY FINANCIAL INC	20,139	39.660	798,712.74	
AMERICAN EXPRESS CO	49,743	250.920	12,481,513.56	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,870	436.350	3,870,424.50	

APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	34,367	107.590	3,697,545.53	
ARES MANAGEMENT CORP - A	16,991	140.080	2,380,099.28	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	61,100	67.720	4,137,692.00	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	113,330	459.610	52,087,601.30	
BLACKROCK INC	12,569	877.940	11,034,827.86	
BLACKSTONE INC	60,652	139.770	8,477,330.04	
BLOCK INC	49,568	61.310	3,039,014.08	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	32,018	142.600	4,565,766.80	
CARLYLE GROUP INC/THE	16,730	37.540	628,044.20	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9,059	211.340	1,914,529.06	
CME GROUP INC	30,011	218.540	6,558,603.94	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	16,066	155.050	2,491,033.30	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	19,925	27.010	538,174.25	
CORPAY INC	6,278	307.400	1,929,857.20	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	21,512	133.330	2,868,194.96	
EQUITABLE HOLDINGS INC	31,450	39.970	1,257,056.50	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,946	428.900	1,263,539.40	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	47,604	82.390	3,922,093.56	
FISERV INC	49,889	172.440	8,602,859.16	
FRANKLIN RESOURCES INC	21,778	19.550	425,759.90	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	4,784	59.180	283,117.12	
GLOBAL PAYMENTS INC	20,594	110.000	2,265,340.00	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	27,281	488.570	13,328,678.17	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	48,090	161.700	7,776,153.00	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,120	171.900	1,052,028.00	
KKR & CO INC	54,340	118.460	6,437,116.40	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	6,164	210.190	1,295,611.16	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,653	257.800	683,943.40	
MASTERCARD INC - A	71,169	487.090	34,665,708.21	
MOODY'S CORP	13,799	482.250	6,654,567.75	
MORGAN STANLEY	103,002	98.180	10,112,736.36	
MSCI INC	6,799	558.340	3,796,153.66	
NASDAQ INC	36,003	71.650	2,579,614.95	
NORTHERN TRUST CORP	16,793	87.760	1,473,753.68	
PAYPAL HOLDINGS INC	85,759	69.350	5,947,386.65	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	17,112	116.850	1,999,537.20	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	50,779	19.660	998,315.14	
S&P GLOBAL INC	27,631	515.830	14,252,898.73	
SCHWAB (CHARLES) CORP	131,436	63.010	8,281,782.36	
SEI INVESTMENTS COMPANY	7,550	66.240	500,112.00	
STATE STREET CORP	25,474	83.660	2,131,154.84	
SYNCHRONY FINANCIAL	32,112	48.170	1,546,835.04	
T ROWE PRICE GROUP INC	20,577	103.540	2,130,542.58	
TOAST INC-CLASS A	35,993	23.620	850,154.66	

TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	8,688	113.900	989,563.20	
VISA INC-CLASS A SHARES	134,891	285.610	38,526,218.51	
AFLAC INC	44,628	109.400	4,882,303.20	
ALLSTATE CORP	22,831	187.200	4,273,963.20	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,866	137.030	666,787.98	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	55,264	72.820	4,024,324.48	
AON PLC-CLASS A	16,323	350.490	5,721,048.27	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	32,647	111.730	3,647,649.31	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	18,202	298.940	5,441,305.88	
ASSURANT INC	4,977	193.260	961,855.02	
BROWN & BROWN INC	20,402	103.720	2,116,095.44	
CHUBB LTD	33,496	292.200	9,787,531.20	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	13,251	137.470	1,821,614.97	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,244	503.190	1,129,158.36	
EVEREST GROUP LTD	3,547	387.020	1,372,759.94	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	24,937	58.900	1,468,789.30	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	25,592	116.910	2,991,960.72	
LOEWS CORP	16,971	80.480	1,365,826.08	
MARKEL GROUP INC	1,175	1,554.560	1,826,608.00	
MARSH & MCLENNAN COS	41,510	230.580	9,571,375.80	
METLIFE INC	52,395	75.480	3,954,774.60	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	19,458	79.210	1,541,268.18	
PROGRESSIVE CORP	50,624	251.310	12,722,317.44	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	32,008	114.950	3,679,319.60	
TRAVELERS COS INC/THE	19,523	241.100	4,706,995.30	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	8,848	294.360	2,604,497.28	
WR BERKLEY CORP	27,229	59.380	1,616,858.02	
ACCENTURE PLC-CL A	53,920	341.810	18,430,395.20	
ADOBE INC	37,625	569.880	21,441,735.00	
AKAMA I TECHNOLOGIES INC	13,226	95.070	1,257,395.82	
ANSYS INC	7,892	309.700	2,444,152.40	
APPLOVIN CORP-CLASS A	19,293	86.310	1,665,178.83	
ASPEN TECHNOLOGY INC	1,901	225.300	428,295.30	
ATLASSIAN CORP-CL A	12,421	162.690	2,020,772.49	
AUTODESK INC	19,029	255.670	4,865,144.43	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	15,779	46.340	731,198.86	
CADENCE DESIGN SYS INC	22,681	252.810	5,733,983.61	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	8,287	188.650	1,563,342.55	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	27,192	76.240	2,073,118.08	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	41,604	76.130	3,167,312.52	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	19,060	246.580	4,699,814.80	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	4,025	259.920	1,046,178.00	
DATADOG INC - CLASS A	22,908	107.700	2,467,191.60	
DOCUSIGN INC	17,164	56.040	961,870.56	

DYNATRACE INC	21,256	50.900	1,081,930.40	
EPAM SYSTEMS INC	4,815	206.120	992,467.80	
FAIR ISAAC CORP	2,176	1,776.490	3,865,642.24	
FORTINET INC	52,961	75.100	3,977,371.10	
GARTNER INC	6,537	492.830	3,221,629.71	
GEN DIGITAL INC	41,779	25.720	1,074,555.88	
GODADDY INC - CLASS A	11,895	152.870	1,818,388.65	
HUBSPOT INC	3,878	494.510	1,917,709.78	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	79,188	203.530	16,117,133.64	
INTUIT INC	24,113	626.990	15,118,609.87	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	4,648	255.080	1,185,611.84	
MICROSOFT CORP	602,701	405.720	244,527,849.72	
MICROSTRATEGY INC-CL A	14,020	124.820	1,749,976.40	
MONDAY.COM LTD	3,167	244.470	774,236.49	
MONGODB INC	5,921	286.580	1,696,840.18	
OKTA INC	13,914	71.270	991,650.78	
ORACLE CORP	142,145	139.890	19,884,664.05	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	178,162	34.600	6,164,405.20	
PALO ALTO NETWORKS INC	27,325	344.050	9,401,166.25	
PTC INC	9,246	167.800	1,551,478.80	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,988	553.390	4,973,869.32	
SALESFORCE INC	82,659	245.760	20,314,275.84	
SAMSARA INC-CL A	13,749	46.140	634,378.86	
SERVICENOW INC	17,689	855.580	15,134,354.62	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	24,978	109.960	2,746,580.88	
SYNOPSYS INC	12,929	464.160	6,001,124.64	
TWILIO INC - A	15,028	58.840	884,247.52	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,550	588.990	2,090,914.50	
VERISIGN INC	7,316	181.960	1,331,219.36	
WIX.COM LTD	3,881	156.400	606,988.40	
WORKDAY INC-CLASS A	18,596	253.520	4,714,457.92	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	23,688	66.590	1,577,383.92	
ZSCALER INC	7,508	159.160	1,194,973.28	
AMPHENOL CORP-CL A	102,192	60.730	6,206,120.16	
APPLE INC	1,243,373	220.910	274,673,529.43	
ARISTA NETWORKS INC	22,318	324.770	7,248,216.86	
CDW CORP/DE	10,704	214.140	2,292,154.56	
CISCO SYSTEMS INC	346,969	48.700	16,897,390.30	
CORNING INC	64,764	40.970	2,653,381.08	
DELL TECHNOLOGIES -C	25,479	105.890	2,697,971.31	
F5 INC	4,939	199.930	987,454.27	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	102,647	17.600	1,806,587.20	
HP INC	85,880	34.180	2,935,378.40	
JABIL INC	9,808	102.680	1,007,085.44	

JUNIPER NETWORKS INC	30,061	38.340	1,152,538.74	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	15,964	145.820	2,327,870.48	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13,944	438.870	6,119,603.28	
NETAPP INC	17,045	114.600	1,953,357.00	
PURE STORAGE INC - CLASS A	28,039	46.390	1,300,729.21	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	15,879	101.340	1,609,177.86	
SUPER MICRO COMPUTER INC	4,557	409.870	1,867,777.59	
TE CONNECTIVITY LTD	25,716	144.820	3,724,191.12	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4,328	424.260	1,836,197.28	
TRIMBLE INC	20,783	54.310	1,128,724.73	
WESTERN DIGITAL CORP	29,044	62.610	1,818,444.84	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,189	327.930	1,373,698.77	
ADVANCED MICRO DEVICES	139,000	138.150	19,202,850.00	
ANALOG DEVICES INC	43,053	218.560	9,409,663.68	
APPLIED MATERIALS INC	69,692	177.550	12,373,814.60	
BROADCOM INC	378,262	140.820	53,266,854.84	
ENPHASE ENERGY INC	10,381	103.040	1,069,658.24	
ENTEGRIS INC	12,569	105.000	1,319,745.00	
FIRST SOLAR INC	8,882	205.360	1,824,007.52	
INTEL CORP	358,536	19.070	6,837,281.52	
KLA CORP	11,357	709.890	8,062,220.73	
LAM RESEARCH CORP	11,046	734.310	8,111,188.26	
MARVELL TECHNOLOGY INC	75,550	68.930	5,207,661.50	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	44,600	75.410	3,363,286.00	
MICRON TECHNOLOGY INC	93,001	86.270	8,023,196.27	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	4,028	836.010	3,367,448.28	
NVIDIA CORP	2,099,584	106.470	223,542,708.48	
NXP SEMICONDUCTORS NV	22,287	230.600	5,139,382.20	
ON SEMICONDUCTOR	35,773	69.390	2,482,288.47	
QORVO INC	7,835	105.270	824,790.45	
QUALCOMM INC	96,155	160.770	15,458,839.35	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,506	99.810	1,348,033.86	
TERADYNE INC	12,464	124.200	1,548,028.80	
TEXAS INSTRUMENTS INC	78,458	201.170	15,783,395.86	
AT&T INC	619,933	21.500	13,328,559.50	
T-MOBILE US INC	45,251	195.300	8,837,520.30	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	363,026	42.730	15,512,100.98	
AES CORP	54,086	16.200	876,193.20	
ALLIANT ENERGY CORP	21,204	59.250	1,256,337.00	
AMEREN CORPORATION	22,382	84.590	1,893,293.38	
AMERICAN ELECTRIC POWER	43,705	103.660	4,530,460.30	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	17,778	146.010	2,595,765.78	
ATMOS ENERGY CORP	13,505	133.800	1,806,969.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	54,717	27.410	1,499,792.97	



CMS ENERGY CORP	27,913	69.120	1,929,346.56	
CONSOLIDATED EDISON INC	28,772	104.750	3,013,867.00	
CONSTELLATION ENERGY	26,817	174.920	4,690,829.64	
DOMINION ENERGY INC	72,436	57.370	4,155,653.32	
DTE ENERGY COMPANY	18,974	124.620	2,364,539.88	
DUKE ENERGY CORP	65,574	117.160	7,682,649.84	
EDISON INTERNATIONAL	32,299	86.090	2,780,620.91	
ENTERGY CORP	17,246	122.170	2,106,943.82	
ESSENTIAL UTILITIES INC	25,795	38.960	1,004,973.20	
EVERGY INC	22,411	60.440	1,354,520.84	
EVERSOURCE ENERGY	30,845	68.060	2,099,310.70	
EXELON CORP	84,941	38.730	3,289,764.93	
FIRSTENERGY CORP	45,110	44.480	2,006,492.80	
NEXTERA ENERGY INC	176,613	81.190	14,339,209.47	
NISOURCE INC	34,855	33.450	1,165,899.75	
NRG ENERGY INC	18,864	77.920	1,469,882.88	
P G & E CORP	174,106	19.810	3,449,039.86	
PPL CORP	61,956	32.440	2,009,852.64	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	42,789	80.420	3,441,091.38	
SEMPRA	53,312	82.940	4,421,697.28	
SOUTHERN CO/THE	92,045	89.320	8,221,459.40	
VISTRA CORP	29,322	74.950	2,197,683.90	
WEC ENERGY GROUP INC	25,816	94.860	2,448,905.76	
XCEL ENERGY INC	45,776	63.490	2,906,318.24	
ALPHABET INC-CL A	501,072	148.710	74,514,417.12	
ALPHABET INC-CL C	431,512	149.540	64,528,304.48	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,601	324.840	2,469,108.84	
COMCAST CORP-CLASS A	333,137	39.720	13,232,201.64	
ELECTRONIC ARTS INC	20,831	144.300	3,005,913.30	
FOX CORP - CLASS A	23,886	40.060	956,873.16	
FOX CORP - CLASS B	8,773	37.090	325,390.57	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	32,096	31.060	996,901.76	
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	16,121	75.440	1,216,168.24	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	13,554	94.800	1,284,919.20	
MATCH GROUP INC	24,529	36.030	883,779.87	
META PLATFORMS INC-CLASS A	187,256	504.790	94,524,956.24	
NETFLIX INC	36,998	675.420	24,989,189.16	
NEWS CORP - CLASS A	34,405	26.600	915,173.00	
OMNICOM GROUP	18,370	98.900	1,816,793.00	
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	40,964	10.310	422,338.84	
PINTEREST INC- CLASS A	48,115	29.410	1,415,062.15	
ROBLOX CORP -CLASS A	37,893	43.620	1,652,892.66	
ROKU INC	9,945	65.410	650,502.45	
SEA LTD-ADR	31,577	76.910	2,428,587.07	

	SNAP INC - A	86,463	8.530	737,529.39	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	14,811	156.320	2,315,255.52	
	TRADE DESK INC/THE -CLASS A	36,722	99.320	3,647,229.04	
	WALT DISNEY CO/THE	154,051	88.340	13,608,865.34	
	WARNER BROS DISCOVERY INC	201,390	7.300	1,470,147.00	
	CBRE GROUP INC - A	27,148	115.260	3,129,078.48	
	COSTAR GROUP INC	33,292	79.530	2,647,712.76	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	79,100	3.740	295,834.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	16,334	54.080	883,342.72	
	アメリカ・ドル小計	31,202,354		3,983,907,155.74 (571,810,194,063)	
カナダ・ドル	ARC RESOURCES LTD	44,923	22.210	997,739.83	
	CAMECO CORP	33,586	50.230	1,687,024.78	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	186,016	45.400	8,445,126.40	
	CENOVUS ENERGY INC	120,048	22.560	2,708,282.88	
	ENBRIDGE INC	189,679	55.310	10,491,145.49	
	IMPERIAL OIL LTD	16,267	92.220	1,500,142.74	
	KEYERA CORP	19,802	41.200	815,842.40	
	MEG ENERGY CORP	21,651	24.070	521,139.57	
	PARKLAND CORP	16,066	35.790	575,002.14	
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,973	55.530	2,552,880.69	
	SUNCOR ENERGY INC	108,809	50.710	5,517,704.39	
	TC ENERGY CORP	90,192	63.870	5,760,563.04	
	TOURMALINE OIL CORP	26,107	58.800	1,535,091.60	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	41,898	105.460	4,418,563.08	
	BARRICK GOLD CORP	157,839	26.150	4,127,489.85	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,268	81.030	1,075,106.04	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	68,446	14.520	993,835.92	
	FRANCO-NEVADA CORP	15,696	163.350	2,563,941.60	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	56,432	15.740	888,239.68	
	KINROSS GOLD CORP	110,156	11.560	1,273,403.36	
	LUNDIN MINING CORP	46,446	11.530	535,522.38	
	NUTRIEN LTD	42,180	62.510	2,636,671.80	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	25,157	25.510	641,755.07	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	40,547	59.980	2,432,009.06	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,438	118.890	527,633.82	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	40,353	79.400	3,204,028.20	
CAE INC	27,474	24.480	672,563.52		
STANTEC INC	9,939	105.750	1,051,049.25		
TOROMONT INDUSTRIES LTD	6,027	121.470	732,099.69		
WSP GLOBAL INC	11,089	226.460	2,511,214.94		
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	32,674	27.820	908,990.68		
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	15,630	53.970	843,551.10		
RB GLOBAL INC	15,569	113.220	1,762,722.18		

THOMSON REUTERS CORP	13,747	228.620	3,142,839.14	
AIR CANADA	12,083	15.070	182,090.81	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	47,256	158.980	7,512,758.88	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	79,413	114.780	9,115,024.14	
TFI INTERNATIONAL INC	6,995	190.030	1,329,259.85	
MAGNA INTERNATIONAL INC	22,436	53.860	1,208,402.96	
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,082	79.560	245,203.92	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	11,302	59.730	675,068.46	
RESTAURANT BRANDS INTERN	25,379	92.010	2,335,121.79	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	4,737	156.540	741,529.98	
DOLLARAMA INC	24,084	128.240	3,088,532.16	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	64,619	77.920	5,035,112.48	
EMPIRE CO LTD 'A'	9,148	38.430	351,557.64	
LOBLAW COMPANIES LTD	14,057	176.060	2,474,875.42	
METRO INC/CN	18,929	85.450	1,617,483.05	
WESTON (GEORGE) LTD	4,984	221.710	1,105,002.64	
SAPUTO INC	18,270	29.900	546,273.00	
BANK OF MONTREAL	60,312	112.600	6,791,131.20	
BANK OF NOVA SCOTIA	102,004	69.570	7,096,418.28	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	78,946	82.100	6,481,466.60	
NATIONAL BANK OF CANADA	29,961	124.590	3,732,840.99	
ROYAL BANK OF CANADA	122,095	166.880	20,375,213.60	
TORONTO-DOMINION BANK	149,615	83.380	12,474,898.70	
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	31,451	57.270	1,801,198.77	
BROOKFIELD CORP	113,931	64.020	7,293,862.62	
IGM FINANCIAL INC	4,949	38.900	192,516.10	
ONEX CORPORATION	4,217	88.790	374,427.43	
TMX GROUP LTD	26,034	43.270	1,126,491.18	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,745	1,611.000	2,811,195.00	
GREAT-WEST LIFECO INC	22,964	44.700	1,026,490.80	
IA FINANCIAL CORP INC	8,268	104.220	861,690.96	
INTACT FINANCIAL CORP	16,097	252.080	4,057,731.76	
MANULIFE FINANCIAL CORP	158,627	37.100	5,885,061.70	
POWER CORP OF CANADA	50,268	41.370	2,079,587.16	
SUN LIFE FINANCIAL INC	46,259	74.610	3,451,383.99	
CGI INC	18,609	153.560	2,857,598.04	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,727	4,219.710	7,287,439.17	
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,424	130.710	839,681.04	
OPEN TEXT CORP	21,507	43.100	926,951.70	
SHOPIFY INC - CLASS A	104,152	92.400	9,623,644.80	
BCE INC	8,653	48.950	423,564.35	
QUEBECOR INC -CL B	14,578	33.960	495,068.88	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	32,571	55.300	1,801,176.30	
TELUS CORP	15,222	23.090	351,475.98	

	ALTAGAS LTD	27,309	34.610	945,164.49	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,200	37.000	414,400.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	7,344	34.870	256,085.28	
	EMERA INC	22,591	51.470	1,162,758.77	
	FORTIS INC	41,868	61.000	2,553,948.00	
	HYDRO ONE LTD	33,037	46.910	1,549,765.67	
	FIRSTSERVICE CORP	3,669	240.680	883,054.92	
	カナダ・ドル小計	3,479,102		237,899,597.72 (25,165,019,447)	
オーストラ リア・ドル	AMPOL LTD	19,016	28.720	546,139.52	
	SANTOS LTD	278,806	6.880	1,918,185.28	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	162,029	23.790	3,854,669.91	
	BHP GROUP LTD	438,420	38.760	16,993,159.20	
	BLUESCOPE STEEL LTD	37,214	20.060	746,512.84	
	FORTESCUE LTD	135,233	16.200	2,190,774.60	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	36,927	53.610	1,979,656.47	
	MINERAL RESOURCES LTD	17,115	30.400	520,296.00	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	92,960	14.650	1,361,864.00	
	ORICA LTD	36,212	17.770	643,487.24	
	PILBARA MINERALS LTD	280,194	2.410	675,267.54	
	RIO TINTO LTD	32,627	106.830	3,485,542.41	
	SOUTH32 LTD	336,639	2.970	999,817.83	
	REECE LTD	13,059	26.650	348,022.35	
	SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	16,425	40.430	664,062.75	
	BRAMBLES LTD	122,717	18.510	2,271,491.67	
	COMPUTERSHARE LTD	50,853	28.040	1,425,918.12	
	QANTAS AIRWAYS LTD	78,226	6.740	527,243.24	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	47,081	54.710	2,575,801.51	
	LOTTERY CORP LTD/THE	173,268	4.970	861,141.96	
	WESFARMERS LTD	96,169	69.470	6,680,860.43	
	COLES GROUP LTD	111,645	18.800	2,098,926.00	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	138,738	4.950	686,753.10	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	107,180	34.640	3,712,715.20	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	62,913	11.490	722,870.37	
	COCHLEAR LTD	5,404	291.370	1,574,563.48	
	PRO MEDICUS LTD	5,586	157.530	879,962.58	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	14,565	39.240	571,530.60	
	SONIC HEALTHCARE LTD	37,362	26.980	1,008,026.76	
	CSL LTD	41,471	300.410	12,458,303.11	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	253,422	31.520	7,987,861.44	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	143,830	142.950	20,560,498.50	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	264,499	38.930	10,296,946.07		
WESTPAC BANKING CORP	303,158	31.870	9,661,645.46		
ASX LTD	15,385	63.550	977,716.75		

	MACQUARIE GROUP LTD	31,658	223.720	7,082,527.76	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	22,786	33.370	760,368.82	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	173,755	7.740	1,344,863.70	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	193,702	3.840	743,815.68	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	124,450	16.220	2,018,579.00	
	SUNCORP GROUP LTD	117,223	17.750	2,080,708.25	
	WISETECH GLOBAL LTD	14,590	125.240	1,827,251.60	
	XERO LTD	12,671	141.610	1,794,340.31	
	TELSTRA GROUP LTD	367,025	3.920	1,438,738.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	134,865	9.560	1,289,309.40	
	CAR GROUP LTD	27,943	36.900	1,031,096.70	
	REA GROUP LTD	3,813	201.380	767,861.94	
	SEEK LTD	29,833	22.970	685,264.01	
	オーストラリア・ドル小計	5,260,662		147,332,959.46 (14,062,930,980)	
香港・ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	235,424	42.500	10,005,520.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	27,000	63.200	1,706,400.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	121,500	103.200	12,538,800.00	
	MTR CORP	118,500	26.450	3,134,325.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	160,000	17.200	2,752,000.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	176,000	28.700	5,051,200.00	
	SANDS CHINA LTD	238,000	13.420	3,193,960.00	
	WH GROUP LTD	722,000	5.710	4,122,620.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	247,000	23.950	5,915,650.00	
	HANG SENG BANK LTD	63,400	92.100	5,839,140.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	102,400	226.600	23,203,840.00	
	AIA GROUP LTD	971,200	54.000	52,444,800.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	62,000	57.700	3,577,400.00	
	CLP HOLDINGS LTD	142,100	69.600	9,890,160.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	861,389	6.180	5,323,384.02	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	111,000	54.450	6,043,950.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	160,924	31.750	5,109,337.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	90,384	23.450	2,119,504.80	
	SINO LAND CO	248,200	8.160	2,025,312.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	135,500	77.050	10,440,275.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	113,000	19.740	2,230,620.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	125,000	21.550	2,693,750.00	
	香港・ドル小計	5,231,921		179,361,947.82 (3,300,259,840)	
シンガポール・ドル	KEPPEL LTD	115,000	6.110	702,650.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	108,600	4.420	480,012.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	113,566	6.310	716,601.46	
	GENTING SINGAPORE LTD	675,000	0.820	553,500.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	159,600	3.140	501,144.00	

	DBS GROUP HOLDINGS LTD	170,270	37.190	6,332,341.30	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	295,500	15.000	4,432,500.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	102,400	31.890	3,265,536.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	65,200	10.980	715,896.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	673,815	3.140	2,115,779.10	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	89,200	4.910	437,972.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	220,100	2.820	620,682.00	
	シンガポール・ドル小計	2,788,251		20,874,613.86 (2,292,450,094)	
ニュージー ランド・ド ル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	133,941	7.570	1,013,933.37	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	46,548	37.550	1,747,877.40	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	121,519	3.510	426,531.69	
	MERCURY NZ LTD	81,489	6.450	525,604.05	
	MERIDIAN ENERGY LTD	102,546	5.960	611,174.16	
	ニュージーランド・ドル小計	486,043		4,325,120.67 (380,740,373)	
イギリス・ ポンド	BP PLC	1,415,483	4.066	5,755,353.87	
	SHELL PLC	541,087	25.460	13,776,075.02	
	ANGLO AMERICAN PLC	104,777	20.295	2,126,449.21	
	ANTOFAGASTA PLC	30,983	16.595	514,162.88	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,296	39.720	408,957.12	
	ENDEAVOUR MINING PLC	17,507	15.600	273,109.20	
	GLENCORE PLC	869,792	3.700	3,218,230.40	
	MONDI PLC	45,625	14.360	655,175.00	
	RIO TINTO PLC	95,791	45.770	4,384,354.07	
	ASHTREAD GROUP PLC	35,259	52.520	1,851,802.68	
	BAE SYSTEMS PLC	267,719	12.960	3,469,638.24	
	BUNZL PLC	26,105	36.480	952,310.40	
	DCC PLC	10,153	51.400	521,864.20	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	119,456	4.721	563,951.77	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	712,449	4.756	3,388,407.44	
	SMITHS GROUP PLC	36,853	17.920	660,405.76	
	SPIRAX GROUP PLC	5,904	74.600	440,438.40	
	EXPERIAN PLC	81,296	36.900	2,999,822.40	
	INTERTEK GROUP PLC	11,884	50.350	598,359.40	
	RELX PLC	159,389	35.840	5,712,501.76	
	RENTOKIL INITIAL PLC	190,467	4.721	899,194.70	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	139,211	4.956	689,929.71	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	10,362	49.510	513,022.62	
	PERSIMMON PLC	27,665	15.945	441,118.42	
TAYLOR WIMPEY PLC	353,772	1.592	563,205.02		
COMPASS GROUP PLC	137,977	24.850	3,428,728.45		
ENTAIN PLC	42,158	6.732	283,807.65		
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	14,491	76.480	1,108,271.68		

PEARSON PLC	46,942	10.585	496,881.07	
WHITBREAD PLC	16,522	30.500	503,921.00	
JD SPORTS FASHION PLC	251,482	1.358	341,512.55	
KINGFISHER PLC	179,593	2.743	492,623.59	
NEXT PLC	9,030	100.650	908,869.50	
SAINSBURY (J) PLC	113,480	2.998	340,213.04	
TESCO PLC	623,187	3.687	2,297,690.46	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	30,992	21.800	675,625.60	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	167,558	29.730	4,981,499.34	
COCA-COLA HBC AG-DI	17,866	28.760	513,826.16	
DIAGEO PLC	189,203	24.390	4,614,661.17	
IMPERIAL BRANDS PLC	69,831	22.570	1,576,085.67	
HALEON PLC	656,454	3.930	2,579,864.22	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	56,558	44.860	2,537,191.88	
UNILEVER PLC	214,792	50.340	10,812,629.28	
NMC HEALTH PLC	3,940	0.010	39.40	
SMITH & NEPHEW PLC	85,977	12.085	1,039,032.04	
ASTRAZENECA PLC	132,243	127.120	16,810,730.16	
GSK PLC	352,557	16.635	5,864,785.69	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	14,590	19.440	283,629.60	
BARCLAYS PLC	1,314,907	2.240	2,945,391.68	
HSBC HOLDINGS PLC	1,585,380	6.611	10,480,947.18	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,165,051	0.572	2,954,409.17	
NATWEST GROUP PLC	581,902	3.338	1,942,388.87	
STANDARD CHARTERED PLC	182,397	7.630	1,391,689.11	
3I GROUP PLC	81,145	30.940	2,510,626.30	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	31,008	11.070	343,258.56	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	41,416	103.750	4,296,910.00	
M&G PLC	217,201	2.084	452,646.88	
SCHRODERS PLC	61,711	3.374	208,212.91	
WISE PLC - A	43,661	6.315	275,719.21	
ADMIRAL GROUP PLC	19,808	28.380	562,151.04	
AVIVA PLC	217,835	4.945	1,077,194.07	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	561,409	2.256	1,266,538.70	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	59,286	5.695	337,633.77	
PRUDENTIAL PLC	232,133	6.136	1,424,368.08	
SAGE GROUP PLC/THE	75,045	9.998	750,299.91	
HALMA PLC	32,277	25.330	817,576.41	
BT GROUP PLC	540,623	1.429	772,550.26	
VODAFONE GROUP PLC	1,981,261	0.765	1,515,664.66	
CENTRICA PLC	527,715	1.225	646,450.87	
NATIONAL GRID PLC	413,245	10.355	4,279,151.97	
SEVERN TRENT PLC	20,117	27.180	546,780.06	
SSE PLC	87,793	19.955	1,751,909.31	

	UNITED UTILITIES GROUP PLC	51,208	10.745	550,229.96	
	AUTO TRADER GROUP PLC	77,901	8.598	669,792.79	
	INFORMA PLC	105,332	8.412	886,052.78	
	WPP PLC	78,503	7.398	580,765.19	
	イギリス・ボンド小計	23,133,978		164,107,268.59 (30,773,395,006)	
イスラエル・シュケル	ICL GROUP LTD	67,143	15.250	1,023,930.75	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,213	742.200	1,642,488.60	
	BANK HAPOALIM BM	98,327	35.450	3,485,692.15	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	135,088	33.840	4,571,377.92	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	118,638	19.810	2,350,218.78	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	11,916	138.800	1,653,940.80	
	NICE LTD	4,458	611.800	2,727,404.40	
	AZRIELI GROUP LTD	3,527	246.600	869,758.20	
	イスラエル・シュケル小計	441,310		18,324,811.60 (699,692,616)	
スイス・フラン	CLARIANT AG-REG	28,111	12.600	354,198.60	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	538	693.000	372,834.00	
	GIVAUDAN-REG	771	4,497.000	3,467,187.00	
	HOLCIM LTD	46,179	79.500	3,671,230.50	
	SIG GROUP AG	22,269	17.200	383,026.80	
	SIKA AG-REG	12,934	263.200	3,404,228.80	
	ABB LTD-REG	135,651	46.070	6,249,441.57	
	GEBERIT AG-REG	2,873	525.000	1,508,325.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,766	233.500	412,361.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,092	239.600	980,443.20	
	VAT GROUP AG	2,164	392.300	848,937.20	
	ADECCO GROUP AG-REG	14,810	27.420	406,090.20	
	SGS SA-REG	11,450	94.760	1,085,002.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	4,194	250.500	1,050,597.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	44,847	119.750	5,370,428.25	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	2,619	159.250	417,075.75	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	5,225	31.350	163,803.75	
	AVOLTA AG	8,656	31.740	274,741.44	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	382	1,448.000	553,136.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	72	11,150.000	802,800.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	109,600.000	876,800.00	
	NESTLE SA-REG	224,024	88.100	19,736,514.40	
	ALCON INC	41,643	82.020	3,415,558.86	
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,173	302.200	1,261,080.60	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,823	117.900	1,040,231.70	
	BACHEM HOLDING AG	1,756	76.700	134,685.20	
GALDERMA GROUP AG	4,744	80.000	379,520.00		
LONZA GROUP AG-REG	6,471	543.200	3,515,047.20		



	NOVARTIS AG-REG	166,888	99.600	16,622,044.80	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,584	287.600	743,158.40	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	60,422	267.200	16,144,758.40	
	SANDOZ GROUP AG	38,614	35.780	1,381,608.92	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	3,006	88.500	266,031.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,168	46.800	709,862.40	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,044	1,109.000	2,266,796.00	
	UBS GROUP AG-REG	285,835	24.530	7,011,532.55	
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,909	162.200	634,039.80	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	4,111	135.300	556,218.30	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,277	698.200	1,589,801.40	
	SWISS RE AG	24,764	115.500	2,860,242.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,448	499.900	6,222,755.20	
	TEMENOS AG - REG	7,049	59.150	416,948.35	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	13,555	71.880	974,333.40	
	SWISSCOM AG-REG	1,994	550.500	1,097,697.00	
	BKW AG	1,385	156.900	217,306.50	
	SWISS PRIME SITE-REG	7,190	96.950	697,070.50	
	スイス・フラン小計	1,294,488		122,547,530.94 (20,700,728,926)	
デンマーク・クローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	30,327	465.000	14,102,055.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	849	2,808.000	2,383,992.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	86,250	149.200	12,868,500.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	292	9,380.000	2,738,960.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	412	9,582.000	3,947,784.00	
	DSV A/S	13,716	1,238.000	16,980,408.00	
	PANDORA A/S	7,823	1,153.000	9,019,919.00	
	CARLSBERG AS-B	8,080	769.600	6,218,368.00	
	COLOPLAST-B	10,365	915.400	9,488,121.00	
	DEMANT A/S	8,178	286.200	2,340,543.60	
	GENMAB A/S	5,493	1,854.500	10,186,768.50	
	NOVO NORDISK A/S-B	275,286	887.000	244,178,682.00	
	ZEALAND PHARMA A/S	5,299	858.000	4,546,542.00	
	DANSKE BANK A/S	59,312	206.600	12,253,859.20	
	TRYG A/S	24,975	155.200	3,876,120.00	
ORSTED A/S	14,988	414.500	6,212,526.00		
	デンマーク・クローネ小計	551,645		361,343,148.30 (7,667,701,607)	
ノルウェー・クローネ	AKER BP ASA	27,948	227.200	6,349,785.60	
	EQUINOR ASA	69,048	269.200	18,587,721.60	
	NORSK HYDRO ASA	149,325	56.020	8,365,186.50	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,718	295.000	3,751,810.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	7,896	1,058.000	8,353,968.00	
	MOWI ASA	36,354	187.600	6,820,010.40	

	ORKLA ASA	63,195	99.000	6,256,305.00	
	SALMAR ASA	6,204	553.500	3,433,914.00	
	DNB BANK ASA	71,576	216.000	15,460,416.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,691	191.100	3,571,850.10	
	TELENOR ASA	48,435	134.800	6,529,038.00	
	ノルウェー・クロネ小計	511,390		87,480,005.20 (1,157,360,469)	
スウェーデン・クロネ	BOLIDEN AB	27,135	291.200	7,901,712.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	7,024	412.000	2,893,888.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	45,662	139.300	6,360,716.60	
	ADDTECH AB-B SHARES	27,319	306.400	8,370,541.60	
	ALFA LAVAL AB	23,093	440.600	10,174,775.80	
	ASSA ABLOY AB-B	80,816	322.300	26,046,996.80	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	235,332	176.300	41,489,031.60	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	125,066	155.600	19,460,269.60	
	BEIJER REF AB	27,042	168.300	4,551,168.60	
	EPIROC AB-A	56,566	189.100	10,696,630.60	
	EPIROC AB-B	33,182	171.900	5,703,985.80	
	HUSQVARNA AB-B SHS	34,897	65.120	2,272,492.64	
	INDUTRADE AB	27,951	303.000	8,469,153.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,223	310.500	2,553,241.50	
	LIFCO AB-B SHS	24,912	325.000	8,096,400.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	109,274	45.110	4,929,350.14	
	SAAB AB-B	27,812	225.200	6,263,262.40	
	SANDVIK AB	87,237	201.600	17,586,979.20	
	SKANSKA AB-B SHS	26,915	201.300	5,417,989.50	
	SKF AB-B SHARES	31,715	180.350	5,719,800.25	
	TRELLEBORG AB-B SHS	21,827	384.400	8,390,298.80	
	VOLVO AB-A SHS	13,283	257.600	3,421,700.80	
	VOLVO AB-B SHS	137,659	254.900	35,089,279.10	
	SECURITAS AB-B SHS	41,010	121.500	4,982,715.00	
	VOLVO CAR AB-B	100,230	24.000	2,405,520.00	
	EVOLUTION AB	14,444	1,009.500	14,581,218.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	52,210	156.900	8,191,749.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	50,329	320.400	16,125,411.60	
	GETINGE AB-B SHS	21,124	220.200	4,651,504.80	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	13,513	319.600	4,318,754.80	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	129,315	157.000	20,302,455.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	126,700	106.050	13,436,535.00	
SWEDBANK AB - A SHARES	72,723	220.800	16,057,238.40		
EQT AB	29,893	324.200	9,691,310.60		
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	10,598	354.000	3,751,692.00		
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	14,289	352.100	5,031,156.90		
INVESTOR AB-B SHS	146,684	298.450	43,777,839.80		

	LUNDBERGS AB-B SHS	6,081	554.000	3,368,874.00	
	ERICSSON LM-B SHS	253,908	75.400	19,144,663.20	
	HEXAGON AB-B SHS	175,674	99.560	17,490,103.44	
	TELE2 AB-B SHS	58,043	119.000	6,907,117.00	
	TELIA CO AB	187,675	33.730	6,330,277.75	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	60,454	82.380	4,980,200.52	
	SAGAX AB-B	14,721	267.000	3,930,507.00	
	スウェーデン・クローナ小計	2,819,560		481,316,508.14 (6,656,607,309)	
ユーロ	ENI SPA	196,350	14.080	2,764,608.00	
	GALP ENERGIA SGPS SA	43,361	17.330	751,446.13	
	NESTE OYJ	31,509	18.050	568,737.45	
	OMV AG	9,988	37.700	376,547.60	
	REPSOL SA	96,457	11.810	1,139,157.17	
	TENARIS SA	41,201	13.000	535,613.00	
	TOTALENERGIES SE	186,444	60.960	11,365,626.24	
	AIR LIQUIDE SA	49,230	166.200	8,182,026.00	
	AKZO NOBEL N.V.	14,109	58.200	821,143.80	
	ARCELORMITTAL	36,865	20.140	742,461.10	
	ARKEMA	5,145	80.000	411,600.00	
	BASF SE	73,728	43.580	3,213,066.24	
	COVESTRO AG	16,049	55.700	893,929.30	
	DSM-FIRMENICH AG	15,761	121.550	1,915,749.55	
	EVONIK INDUSTRIES AG	17,669	19.715	348,344.33	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	12,541	91.960	1,153,270.36	
	OCI NV	11,025	28.250	311,456.25	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	47,758	10.785	515,070.03	
	SYENSCO SA	6,353	70.760	449,538.28	
	SYMRISE AG	11,030	120.750	1,331,872.50	
	UPM-KYMMENE OYJ	43,970	28.940	1,272,491.80	
	VOESTALPINE AG	12,233	20.420	249,797.86	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	19,741	40.300	795,562.30	
	AIRBUS SE	49,345	129.760	6,403,007.20	
	ALSTOM	25,574	17.105	437,443.27	
	BOUYGUES SA	17,123	32.150	550,504.45	
	BRENTAG SE	12,153	64.960	789,458.88	
	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	36,112	76.840	2,774,846.08	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	44,374	30.960	1,373,819.04	
	DASSAULT AVIATION SA	1,720	188.500	324,220.00	
	EIFFAGE	6,641	96.080	638,067.28	
	FERROVIAL SE	42,157	38.080	1,605,338.56	
	GEA GROUP AG	10,467	42.200	441,707.40	
	IMCD NV	4,340	151.650	658,161.00	
	KINGSPAN GROUP PLC	11,723	76.900	901,498.70	

KNORR-BREMSE AG	7,217	74.750	539,470.75	
KONE OYJ-B	27,371	48.890	1,338,168.19	
LEGRAND SA	20,908	98.340	2,056,092.72	
LEONARDO SPA	35,486	20.390	723,559.54	
METSO CORP	50,483	8.418	424,965.89	
MTU AERO ENGINES AG	4,961	270.300	1,340,958.30	
PRYSMIAN SPA	24,541	60.460	1,483,748.86	
RATIONAL AG	350	877.500	307,125.00	
REXEL SA	23,491	22.440	527,138.04	
RHEINMETALL AG	3,447	507.000	1,747,629.00	
SAFRAN SA	29,905	194.050	5,803,065.25	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	46,198	219.300	10,131,221.40	
SIEMENS AG-REG	64,408	162.600	10,472,740.80	
SIEMENS ENERGY AG	55,049	24.600	1,354,205.40	
THALES SA	8,928	145.100	1,295,452.80	
VINCI SA	41,998	109.800	4,611,380.40	
WARTSILA OYJ ABP	45,125	18.705	844,063.12	
BUREAU VERITAS SA	30,794	29.120	896,721.28	
RANDSTAD NV	8,946	42.360	378,952.56	
TELEPERFORMANCE	4,299	98.900	425,171.10	
WOLTERS KLUWER	20,806	152.550	3,173,955.30	
ADP	3,679	117.600	432,650.40	
AENA SME SA	5,921	185.000	1,095,385.00	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	50,885	5.824	296,354.24	
DHL GROUP	90,860	39.000	3,543,540.00	
GETLINK SE	30,428	16.095	489,738.66	
INPOST SA	24,153	18.340	442,966.02	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	27,028	77.640	2,098,453.92	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	6,498	72.850	473,379.30	
CONTINENTAL AG	8,078	58.780	474,824.84	
DR ING HC F PORSCHE AG	8,498	66.360	563,927.28	
FERRARI NV	10,626	428.000	4,547,928.00	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	66,276	58.240	3,859,914.24	
MICHELIN (CGDE)	59,151	35.640	2,108,141.64	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	14,142	39.540	559,174.68	
RENAULT SA	14,764	39.730	586,573.72	
STELLANTIS NV	190,785	14.064	2,683,200.24	
VOLKSWAGEN AG-PREF	16,257	91.760	1,491,742.32	
ADIDAS AG	13,498	214.000	2,888,572.00	
HERMES INTERNATIONAL	2,670	1,904.500	5,085,015.00	
KERING	6,767	230.300	1,558,440.10	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	23,687	616.200	14,595,929.40	
MONCLER SPA	19,596	49.910	978,036.36	
PUMA SE	9,601	39.370	377,991.37	

SEB SA	1,127	91.250	102,838.75	
ACCOR SA	16,469	38.300	630,762.70	
AMADEUS IT GROUP SA	40,884	62.740	2,565,062.16	
DELIVERY HERO SE	13,293	28.000	372,204.00	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,785	38.300	221,565.50	
SODEXO SA	6,960	80.300	558,888.00	
D'ETEREN GROUP	1,244	226.000	281,144.00	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	93,013	46.550	4,329,755.15	
PROSUS NV	117,720	32.450	3,820,014.00	
ZALANDO SE	17,418	22.040	383,892.72	
CARREFOUR SA	49,914	14.970	747,212.58	
JERONIMO MARTINS	22,106	16.500	364,749.00	
KESKO OYJ-B SHS	20,250	18.525	375,131.25	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	78,401	31.270	2,451,599.27	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	78,137	57.760	4,513,193.12	
DANONE	55,871	65.740	3,672,959.54	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	48,521	8.220	398,842.62	
HEINEKEN HOLDING NV	10,567	68.450	723,311.15	
HEINEKEN NV	22,805	81.980	1,869,553.90	
JDE PEET'S NV	13,317	20.880	278,058.96	
KERRY GROUP PLC-A	14,401	93.850	1,351,533.85	
LOTUS BAKERIES	31	11,860.000	367,660.00	
PERNOD RICARD SA	17,848	124.300	2,218,506.40	
BEIERSDORF AG	8,764	128.000	1,121,792.00	
HENKEL AG & CO KGAA	8,714	73.500	640,479.00	
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	15,381	80.920	1,244,630.52	
L'OREAL	20,209	383.550	7,751,161.95	
AMPLIFON SPA	10,123	28.340	286,885.82	
BIOMERIEUX	2,791	110.300	307,847.30	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,583	59.000	211,397.00	
DIASORIN SPA	1,313	103.250	135,567.25	
ESSILORLUXOTTICA	25,357	211.500	5,363,005.50	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	17,125	35.940	615,472.50	
FRESENIUS SE & CO KGAA	31,227	33.630	1,050,164.01	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	71,360	27.240	1,943,846.40	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	23,498	50.100	1,177,249.80	
ARGENX SE	5,283	498.900	2,635,688.70	
BAYER AG-REG	82,511	28.680	2,366,415.48	
EUROFINS SCIENTIFIC	14,665	53.000	777,245.00	
GRIFOLS SA	15,169	9.298	141,041.36	
IPSEN	3,380	110.000	371,800.00	
MERCK KGAA	11,293	169.900	1,918,680.70	
ORION OYJ-CLASS B	10,542	48.780	514,238.76	
QIAGEN N.V.	20,951	40.955	858,048.20	

RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	8,068	51.850	418,325.80	
SANOFI	96,131	105.760	10,166,814.56	
SARTORIUS AG-VORZUG	2,164	252.300	545,977.20	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,207	188.750	416,571.25	
UCB SA	10,385	162.800	1,690,678.00	
ABN AMRO BANK NV-CVA	43,340	15.230	660,068.20	
AIB GROUP PLC	154,127	5.280	813,790.56	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	484,418	9.034	4,376,232.21	
BANCO BPM SPA	108,163	5.950	643,569.85	
BANCO DE SABADELL SA	515,705	1.824	940,645.92	
BANCO SANTANDER SA	1,319,421	4.342	5,728,925.98	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	87,661	9.974	874,330.81	
BNP PARIBAS	87,860	62.570	5,497,400.20	
CAIXABANK SA	308,048	5.428	1,672,084.54	
COMMERZBANK AG	82,105	12.905	1,059,565.02	
CREDIT AGRICOLE SA	90,899	14.275	1,297,583.22	
ERSTE GROUP BANK AG	30,160	48.170	1,452,807.20	
FINECOBANK SPA	60,333	15.555	938,479.81	
ING GROEP NV	280,658	16.164	4,536,555.91	
INTESA SANPAOLO	1,231,042	3.726	4,586,862.49	
KBC GROUP NV	20,304	67.540	1,371,332.16	
MEDIOBANCA SPA	47,708	15.165	723,491.82	
NORDEA BANK ABP	266,860	10.585	2,824,713.10	
SOCIETE GENERALE SA	68,477	22.050	1,509,917.85	
UNICREDIT SPA	125,812	36.605	4,605,348.26	
ADYEN NV	1,711	1,302.400	2,228,406.40	
AMUNDI SA	3,955	66.800	264,194.00	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	161,748	15.030	2,431,072.44	
DEUTSCHE BOERSE AG	16,203	209.700	3,397,769.10	
EDENRED	20,297	37.990	771,083.03	
EURAZEO SE	3,897	70.350	274,153.95	
EURONEXT NV	7,818	100.200	783,363.60	
EXOR NV	8,669	98.600	854,763.40	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	7,933	68.900	546,583.70	
NEXI SPA	57,060	6.426	366,667.56	
SOFINA	1,314	246.600	324,032.40	
AEGON LTD	127,748	5.480	700,059.04	
AGEAS	11,247	46.040	517,811.88	
ALLIANZ SE-REG	32,898	283.700	9,333,162.60	
ASR NEDERLAND NV	14,593	44.310	646,615.83	
AXA SA	152,526	34.910	5,324,682.66	
GENERALI	82,510	25.290	2,086,677.90	
HANNOVER RUECK SE	5,315	253.700	1,348,415.50	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	11,630	482.300	5,609,149.00	

NN GROUP NV	20,802	44.840	932,761.68	
POSTE ITALIANE SPA	34,720	12.475	433,132.00	
SAMPO OYJ-A SHS	41,813	40.900	1,710,151.70	
TALANX AG	5,345	75.900	405,685.50	
BECHTLE AG	8,953	36.480	326,605.44	
CAPGEMINI SE	12,750	180.450	2,300,737.50	
DASSAULT SYSTEMES SE	57,951	34.030	1,972,072.53	
NEMETSCHKE SE	5,941	87.700	521,025.70	
SAP SE	89,076	192.580	17,154,256.08	
NOKIA OYJ	442,364	3.860	1,707,525.04	
ASM INTERNATIONAL NV	4,006	540.200	2,164,041.20	
ASML HOLDING NV	34,249	676.500	23,169,448.50	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	6,286	105.150	660,972.90	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	106,869	29.235	3,124,315.21	
STMICROELECTRONICS NV	54,733	26.100	1,428,531.30	
CELLNEX TELECOM SA	39,938	35.390	1,413,405.82	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	301,061	26.230	7,896,830.03	
ELISA OYJ	14,245	46.460	661,822.70	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	28,190	11.050	311,499.50	
KONINKLIJKE KPN NV	367,935	3.777	1,389,690.49	
ORANGE	153,827	10.750	1,653,640.25	
TELECOM ITALIA SPA	696,355	0.231	160,858.00	
TELEFONICA SA	375,409	4.205	1,578,594.84	
ACCIONA SA	1,810	127.500	230,775.00	
E.ON SE	196,435	13.425	2,637,139.87	
EDP RENOVAVEIS SA	27,294	15.660	427,424.04	
EDP SA	255,288	4.083	1,042,340.90	
ELIA GROUP SA/NV	3,348	105.500	353,214.00	
ENDESA SA	25,535	19.505	498,060.17	
ENEL SPA	694,419	7.054	4,898,431.62	
ENGIE	165,196	15.980	2,639,832.08	
FORTUM OYJ	42,339	14.220	602,060.58	
IBERDROLA SA	532,553	13.330	7,098,931.49	
REDEIA CORP SA	34,539	17.450	602,705.55	
RWE AG	53,937	33.170	1,789,090.29	
SNAM SPA	168,809	4.595	775,677.35	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA	109,980	8.120	893,037.60	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	57,958	29.800	1,727,148.40	
VERBUND AG	5,338	77.250	412,360.50	
BOLLORE SE	69,288	5.690	394,248.72	
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	6,099	87.100	531,222.90	
PUBLICIS GROUPE	20,799	95.660	1,989,632.34	
SCOUT24 SE	6,149	73.600	452,566.40	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	66,170	23.420	1,549,701.40	

VIVENDI SE	57,161	10.085	576,468.68	
LEG IMMOBILIEN SE	7,909	93.020	735,695.18	
VONOVIA SE	60,885	32.780	1,995,810.30	
ユーロ小計	15,501,310		427,237,862.63 (67,644,570,790)	
合計	92,702,014		752,311,651,520 (752,311,651,520)	

(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	572銘柄	73.6%	76.0%
カナダ・ドル	株式	84銘柄	3.2%	3.3%
オーストラリア・ドル	株式	48銘柄	1.8%	1.9%
香港・ドル	株式	22銘柄	0.4%	0.4%
シンガポール・ドル	株式	12銘柄	0.3%	0.3%
ニュージーランド・ドル	株式	5銘柄	0.0%	0.1%
イギリス・ポンド	株式	76銘柄	4.0%	4.1%
イスラエル・シケル	株式	8銘柄	0.1%	0.1%
スイス・フラン	株式	46銘柄	2.7%	2.8%
デンマーク・クローネ	株式	16銘柄	1.0%	1.0%
ノルウェー・クローネ	株式	11銘柄	0.1%	0.2%
スウェーデン・クローナ	株式	44銘柄	0.9%	0.9%
ユーロ	株式	214銘柄	8.7%	9.0%

(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
新株予約権証券	カナダ・ドル	CONSTELLATION SOFTWARE INC-CW40	1,480.00	-	
		カナダ・ドル小計	1,480.00	- (-)	
新株予約権証券合計				- (-)	
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	13,343.00	1,577,809.75	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	26,290.00	1,030,305.10	
		AMERICAN TOWER CORP	39,217.00	9,354,431.01	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	35,166.00	711,056.52	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,975.00	2,700,242.75	
		BXP INC	13,802.00	1,025,488.60	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,861.00	953,696.52	
		CROWN CASTLE INC	36,492.00	4,289,269.68	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	27,519.00	4,109,687.46	
		EQUINIX INC	8,298.00	6,902,276.40	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,256.00	1,057,795.20	
		EQUITY RESIDENTIAL	29,734.00	2,233,023.40	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,455.00	1,636,772.75	



	EXTRA SPACE STORAGE INC	17,630.00	3,080,666.20	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	22,625.00	1,178,988.75	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	65,292.00	1,444,911.96	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	59,277.00	994,075.29	
	INVITATION HOMES INC	55,309.00	1,973,978.21	
	IRON MOUNTAIN INC	23,774.00	2,624,411.86	
	KIMCO REALTY CORP	57,934.00	1,349,282.86	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,567.00	1,533,590.10	
	PROLOGIS INC	78,263.00	10,193,755.75	
	PUBLIC STORAGE	13,973.00	4,911,509.50	
	REALTY INCOME CORP	76,815.00	4,828,590.90	
	REGENCY CENTERS CORP	13,101.00	975,238.44	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,887.00	2,131,369.21	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	28,094.00	4,549,261.42	
	SUN COMMUNITIES INC	10,118.00	1,416,520.00	
	UDR INC	27,406.00	1,220,115.12	
	VENTAS INC	34,880.00	2,237,900.80	
	VICI PROPERTIES INC	84,341.00	2,855,786.26	
	WELLTOWER INC	52,362.00	6,667,253.46	
	WEYERHAEUSER CO	65,282.00	1,976,086.14	
	WP CAREY INC	16,778.00	1,034,028.14	
	アメリカ・ドル小計	1,091,116.00	96,759,175.51 (13,887,844,461)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,170.00	433,990.40	
	カナダ・ドル小計	8,170.00	433,990.40 (45,907,505)	
オーストラリア・ドル	APA GROUP	108,912.00	802,681.44	
	DEXUS/AU	125,845.00	945,095.95	
	GOODMAN GROUP	141,942.00	4,745,121.06	
	GPT GROUP	159,776.00	814,857.60	
	MIRVAC GROUP	326,863.00	719,098.60	
	SCENTRE GROUP	452,086.00	1,604,905.30	
	STOCKLAND	193,824.00	1,007,884.80	
	TRANSURBAN GROUP	256,783.00	3,492,248.80	
	VICINITY CENTRES	372,431.00	852,866.99	
	オーストラリア・ドル小計	2,138,462.00	14,984,760.54 (1,430,295,394)	
香港・ドル	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	437,000.00	4,378,740.00	
	LINK REIT	238,500.00	8,884,125.00	
	香港・ドル小計	675,500.00	13,262,865.00 (244,036,716)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	322,200.00	931,158.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	408,716.00	862,390.76	

シンガポール・ドル小計		730,916.00	1,793,548.76 (196,967,525)	
イギリス・ ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	59,857.00	391,464.78	
	SEGRO PLC	115,483.00	1,018,329.09	
イギリス・ポンド小計		175,340.00	1,409,793.87 (264,364,548)	
ユーロ	COVIVIO	7,110.00	381,807.00	
	GECINA SA	3,082.00	322,993.60	
	KLEPIERRE	18,172.00	506,998.80	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	8,942.00	672,796.08	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	14,027.00	347,869.60	
ユーロ小計		51,333.00	2,232,465.08 (353,466,196)	
投資証券合計			16,422,882,343 (16,422,882,343)	
合 計			16,422,882,343 (16,422,882,343)	

(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 新株予約権証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 34銘柄	-	1.8%	84.6%
カナダ・ドル	新株予約権証券 1銘柄	-	-	-
	投資証券 1銘柄	-	0.0%	0.3%
オーストラリア・ドル	投資証券 9銘柄	-	0.2%	8.7%
香港・ドル	投資証券 2銘柄	-	0.0%	1.5%
シンガポール・ドル	投資証券 2銘柄	-	0.0%	1.2%
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%	2.2%

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。

## エマージング株式インデックス・マザーファンド

### (1) 貸借対照表

(単位：円)

(2024年9月10日現在)

#### 資産の部

##### 流動資産

預金	1,635,120,668
金銭信託	540,143
コール・ローン	100,370,265
株式	38,999,228,042
投資信託受益証券	1,569,128,915
投資証券	3,347,981,612
派生商品評価勘定	3,737,171
未収入金	2,182,923

未収配当金	73,858,610
差入委託証拠金	676,128,848
流動資産合計	46,408,277,197
資産合計	46,408,277,197
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	59,267,843
未払解約金	1,779,553
流動負債合計	61,047,396
負債合計	61,047,396
純資産の部	
元本等	
元本	23,413,171,122
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	22,934,058,679
元本等合計	46,347,229,801
純資産合計	46,347,229,801
負債純資産合計	46,408,277,197

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年9月12日 至 2024年9月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資信託受益証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## （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9月10日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	23,413,171,122口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.9795円 (1万口当たりの純資産額19,795円)

## （金融商品に関する注記）

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年9月12日 至 2024年9月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券</p> <p>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、投資信託受益証券、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引</p> <p>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2024年9月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(株式、投資信託受益証券、投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2024年9月10日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MSCI EMGMKT SEP24	2,509,016,353	-	2,453,329,584	55,686,769
	小計	2,509,016,353	-	2,453,329,584	55,686,769
合 計		2,509,016,353	-	2,453,329,584	55,686,769

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

- 2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	28,600,000	-	28,756,097	156,097
	小計	28,600,000	-	28,756,097	156,097
合 計		28,600,000	-	28,756,097	156,097

## (注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

自 2023年9月12日

至 2024年9月10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9月10日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	20,017,222,114円
同期中における追加設定元本額	6,591,879,105円
同期中における一部解約元本額	3,195,930,097円
2024年9月10日現在の元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	12,454,207,662円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	3,522,561,186円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	21,555,748円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	163,832,351円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	110,983,901円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	71,860,480円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	126,064,083円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	96,717,179円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	480,854,552円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	333,559,569円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	520,021,139円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	149,533,932円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	9,894,008円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	446,710,780円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	4,579,217,458円
三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド	102,059,565円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	19,499,720円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	12,813,997円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	14,687,727円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	7,962,761円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	4,814,581円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	298,679円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	7,544,287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)	38,028,973円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	39,981,951円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	15,683,056円
SMA M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	62,221,797円
合計	23,413,171,122円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	42,200	1.895	79,969.00	

アメリカ・ドル	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	6,558	11.980	78,564.84	
	SOUTHERN COPPER CORP	3,538	95.350	337,348.30	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	7,842	29.900	234,475.80	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	16,231	7.660	124,329.46	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	15,709	34.060	535,048.54	
	PDD HOLDINGS INC	28,413	92.460	2,627,065.98	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	15,698	12.740	199,992.52	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	3,231	50.360	162,713.16	
	CREDICORP LTD	2,745	173.520	476,312.40	
	INTER & CO INC - CL A	9,819	7.190	70,598.61	
	NU HOLDINGS LTD/CAYMAN ISL-A	120,588	13.810	1,665,320.28	
	PAGSEGURO DIGITAL LTD-CL A	8,080	9.170	74,093.60	
	QIFU TECHNOLOGY INC	5,288	24.830	131,301.04	
	STONECO LTD-A	10,214	11.180	114,192.52	
	XP INC - CLASS A	15,095	18.200	274,729.00	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	28,195	1.376	38,796.32	
	AUTOHOME INC-ADR	2,773	27.550	76,396.15	
	IQIYI INC-ADR	21,954	2.070	45,444.78	
	KANZHUN LTD - ADR	10,834	12.230	132,499.82	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	29,713	10.150	301,586.95	
KE HOLDINGS INC-ADR	25,734	14.520	373,657.68		
	アメリカ・ドル小計	430,452		8,154,436.75 (1,170,406,307)	
香港・ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	72,000	8.440	607,680.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	74,000	6.360	470,640.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,008,000	4.390	4,425,120.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	141,000	30.100	4,244,100.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	52,000	7.580	394,160.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	854,000	5.930	5,064,220.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	145,600	9.420	1,371,552.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	176,000	4.490	790,240.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	53,000	16.560	877,680.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	122,000	9.740	1,188,280.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	216,000	2.130	460,080.00	
	CMOC GROUP LTD-H	150,000	5.500	825,000.00	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	51,000	11.920	607,920.00	
	MMG LTD	120,000	1.980	237,600.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	25,000	13.780	344,500.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	54,000	11.780	636,120.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	240,000	13.820	3,316,800.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	99,000	3.150	311,850.00	
	BOC AVIATION LTD	10,300	64.000	659,200.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	126,000	3.770	475,020.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	152,000	3.170	481,840.00		



CHINA STATE CONSTRUCTION INT	92,000	10.620	977,040.00	
CITIC LTD	233,000	7.340	1,710,220.00	
CRRC CORP LTD - H	203,000	4.440	901,320.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	72,000	3.890	280,080.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	21,000	20.550	431,550.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	30,000	19.120	573,600.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	89,000	11.100	987,900.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	19,400	25.250	489,850.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	60,140	11.920	716,868.80	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	114,400	9.780	1,118,832.00	
JD LOGISTICS INC	70,500	9.520	671,160.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	50,000	7.630	381,500.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	6,000	93.300	559,800.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	78,000	4.770	372,060.00	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC	17,300	167.600	2,899,480.00	
BYD CO LTD-H	42,000	235.000	9,870,000.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	23,600	46.100	1,087,960.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	252,000	8.880	2,237,760.00	
GREAT WALL MOTOR CO LTD-H	85,000	11.180	950,300.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	81,200	2.270	184,324.00	
LI AUTO INC-CLASS A	50,600	71.900	3,638,140.00	
NIO INC-CLASS A	55,210	38.550	2,128,345.50	
XPENG INC - CLASS A SHARES	46,700	32.400	1,513,080.00	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	48,000	10.880	522,240.00	
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG	19,900	24.000	477,600.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	53,400	73.900	3,946,260.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	172,000	3.670	631,240.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	96,400	23.250	2,241,300.00	
HISENSE HOME APPLIANCES GR-H	14,000	20.400	285,600.00	
LI NING CO LTD	98,000	13.800	1,352,400.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	34,400	59.450	2,045,080.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	59,000	12.720	750,480.00	
MEITUAN-CLASS B	201,660	118.600	23,916,876.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	63,100	46.500	2,934,150.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	52,400	15.080	790,192.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	29,000	9.370	271,730.00	
TRIP.COM GROUP LTD	22,850	368.600	8,422,510.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	619,900	78.300	48,538,170.00	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	68,200	5.950	405,790.00	
JD.COM INC-CLASS A	101,685	101.200	10,290,522.00	
MINISO GROUP HOLDING LTD	13,200	32.300	426,360.00	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	21,000	47.800	1,003,800.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	49,000	2.650	129,850.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	33,000	9.010	297,330.00	

ALIBABA HEALTH INFORMATION T	208,000	2.860	594,880.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	40,800	24.000	979,200.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	5,000	98.180	490,900.00	
CHINA FEIHE LTD	127,000	4.200	533,400.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	133,000	12.480	1,659,840.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	68,000	23.350	1,587,800.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	78,600	26.000	2,043,600.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	89,000	8.800	783,200.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	90,000	10.480	943,200.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	26,000	42.650	1,108,900.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	166,000	4.670	775,220.00	
GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD	14,200	39.900	566,580.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	25,500	23.300	594,150.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	78,400	4.300	337,120.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	24,700	10.300	254,410.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	55,600	16.440	914,064.00	
AKESO INC	27,000	55.800	1,506,600.00	
BEIGENE LTD	28,500	115.600	3,294,600.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	54,500	5.220	284,490.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	324,800	4.660	1,513,568.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	50,000	10.700	535,000.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	48,000	18.680	896,640.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	48,500	41.750	2,024,875.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	387,000	3.140	1,215,180.00	
WUXI APPTec CO LTD-H	13,711	35.950	492,910.45	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	150,500	11.340	1,706,670.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,160,000	3.510	4,071,600.00	
BANK OF CHINA LTD-H	3,266,000	3.340	10,908,440.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	377,000	5.230	1,971,710.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	363,000	4.410	1,600,830.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	3,933,000	5.340	21,002,220.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	77,000	2.280	175,560.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	158,500	29.150	4,620,275.00	
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	265,100	2.690	713,119.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	2,850,000	4.160	11,856,000.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	326,000	4.030	1,313,780.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	132,000	4.150	547,800.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	58,400	8.240	481,216.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	64,500	11.760	758,520.00	
FAR EAST HORIZON LTD	84,000	5.360	450,240.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	80,800	3.660	295,728.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	43,200	8.480	366,336.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	292,000	11.220	3,276,240.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	110,400	20.150	2,224,560.00	

CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	61,000	9.730	593,530.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	30,100	16.100	484,610.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	397,000	2.990	1,187,030.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	286,000	10.360	2,962,960.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	269,500	34.750	9,365,125.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	104,000	6.100	634,400.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	33,000	30.400	1,003,200.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	29,000	26.200	759,800.00	
LENOVO GROUP LTD	316,000	9.140	2,888,240.00	
SUNNY OPTICAL TECH	31,500	46.600	1,467,900.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	631,600	18.620	11,760,392.00	
ZTE CORP-H	23,800	14.880	354,144.00	
GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	846,000	1.140	964,440.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	19,000	15.680	297,920.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	194,000	2.940	570,360.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	1,886,000	0.980	1,848,280.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	17,000	24.000	408,000.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	206,000	2.190	451,140.00	
CGN POWER CO LTD-H	446,000	2.800	1,248,800.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	94,400	6.190	584,336.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	141,000	5.480	772,680.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	211,000	3.370	711,070.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	39,400	28.750	1,132,750.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	78,000	20.200	1,575,600.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	32,300	46.900	1,514,870.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	92,000	4.510	414,920.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	152,000	4.190	636,880.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	162,000	7.330	1,187,460.00	
BAIDU INC-CLASS A	91,900	79.050	7,264,695.00	
BILIBILI INC-CLASS Z	10,220	117.900	1,204,938.00	
CHINA LITERATURE LTD	12,200	25.100	306,220.00	
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	304,000	2.110	641,440.00	
KINGSOFT CORP LTD	33,600	21.000	705,600.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	98,500	39.350	3,875,975.00	
NETEASE INC	77,700	121.200	9,417,240.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	266,600	371.200	98,961,920.00	
C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	21,000	11.460	240,660.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	152,500	11.460	1,747,650.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	126,000	19.980	2,517,480.00	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	23,400	24.050	562,770.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	78,900	3.930	310,077.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	80,500	8.310	668,955.00	
香港・ドル小計	31,811,876		442,627,880.75 (8,144,353,006)	

台湾・ドル	ASIA CEMENT CORP	103,000	44.750	4,609,250.00	
	CHINA STEEL CORP	489,000	20.550	10,048,950.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	128,000	37.350	4,780,800.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	159,000	45.000	7,155,000.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	198,000	39.400	7,801,200.00	
	TCC GROUP HOLDINGS CO LTD	270,676	31.550	8,539,827.80	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	5,000	776.000	3,880,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	105,000	36.100	3,790,500.00	
	FORTUNE ELECTRIC CO LTD	5,500	552.000	3,036,000.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	3,000	1,975.000	5,925,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	108,000	31.900	3,445,200.00	
	CHINA AIRLINES LTD	106,000	20.250	2,146,500.00	
	EVA AIRWAYS CORP	120,000	34.900	4,188,000.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	39,096	179.000	6,998,184.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	64,000	29.100	1,862,400.00	
	WAN HAI LINES LTD	25,605	75.200	1,925,496.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	75,000	60.600	4,545,000.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	63,000	49.150	3,096,450.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	9,000	515.000	4,635,000.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	21,276	139.500	2,968,002.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	6,000	465.500	2,793,000.00	
	POU CHEN	104,000	33.950	3,530,800.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	12,200	620.000	7,564,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	21,000	286.000	6,006,000.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	202,000	84.000	16,968,000.00	
	PHARMAESSENTIA CORP	9,000	683.000	6,147,000.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	278,418	17.450	4,858,394.10	
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	654,000	32.700	21,385,800.00	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	561,385	27.900	15,662,641.50	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	474,876	26.950	12,797,908.20	
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	358,519	25.250	9,052,604.75	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	484,702	39.100	18,951,848.20	
	SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	430,039	23.300	10,019,908.70	
	TAISHIN FINANCIAL HOLDING	491,828	18.700	9,197,183.60	
	TAIWAN BUSINESS BANK	237,530	15.450	3,669,838.50	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	453,197	25.500	11,556,523.50	
	THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	143,299	38.700	5,545,671.30	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	58,988	142.000	8,376,296.00	
	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	427,393	29.700	12,693,572.10	
	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	388,000	62.500	24,250,000.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	332,741	86.000	28,615,726.00		
KGI FINANCIAL HOLDING CO LTD	639,196	16.050	10,259,095.80		
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	616,432	13.100	8,075,259.20		
ACCTON TECHNOLOGY CORP	20,000	515.000	10,300,000.00		

ACER INC	111,000	41.750	4,634,250.00	
ADVANTECH CO LTD	18,727	321.500	6,020,730.50	
ASIA VITAL COMPONENTS	13,000	545.000	7,085,000.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	28,000	533.000	14,924,000.00	
AUO CORP	296,600	15.600	4,626,960.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	26,000	241.000	6,266,000.00	
COMPAL ELECTRONICS	157,000	33.100	5,196,700.00	
DELTA ELECTRONICS INC	79,000	362.500	28,637,500.00	
E INK HOLDINGS INC	37,000	282.500	10,452,500.00	
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	22,000	249.000	5,478,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	509,800	172.000	87,685,600.00	
INNOLUX CORP	331,903	14.050	4,663,237.15	
INVENTEC CORP	110,000	42.250	4,647,500.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	4,480	2,700.000	12,096,000.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	84,000	101.500	8,526,000.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	27,000	170.000	4,590,000.00	
PEGATRON CORP	81,000	100.000	8,100,000.00	
QUANTA COMPUTER INC	108,000	250.000	27,000,000.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	53,000	72.100	3,821,300.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	56,000	142.000	7,952,000.00	
WISTRON CORP	114,000	96.800	11,035,200.00	
WIWYNN CORP	4,000	1,715.000	6,860,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	62,520	76.300	4,770,276.00	
YAGEO CORPORATION	17,427	593.000	10,334,211.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	30,000	122.000	3,660,000.00	
ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	3,000	2,325.000	6,975,000.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	131,000	142.000	18,602,000.00	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	3,000	2,250.000	6,750,000.00	
GLOBAL UNICHIP CORP	4,000	1,020.000	4,080,000.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	11,000	451.000	4,961,000.00	
MEDIATEK INC	62,000	1,105.000	68,510,000.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	48,000	46.050	2,210,400.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	23,000	518.000	11,914,000.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	20,000	495.000	9,900,000.00	
SILERGY CORP	13,800	414.000	5,713,200.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	1,002,000	899.000	900,798,000.00	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	448,000	53.800	24,102,400.00	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	40,000	113.500	4,540,000.00	
WINBOND ELECTRONICS CORP	118,000	21.200	2,501,600.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	159,000	123.500	19,636,500.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	72,000	92.600	6,667,200.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	73,000	115.000	8,395,000.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	73,443	45.850	3,367,361.55	
台湾・ドル小計	14,187,596		1,772,340,457.45	

				(7,920,943,971)	
エジプト・ ポンド	EASTERN CO SAE	48,781	24.000	1,170,744.00	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BAN	96,608	85.500	8,259,984.00	
	T M G HOLDING	30,309	59.660	1,808,234.94	
エジプト・ポンド小計		175,698		11,238,962.94 (33,341,506)	
トルコ・リ ラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	38,176	161.300	6,157,788.80	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	48,657	46.720	2,273,255.04	
	SASA POLYESTER SANAYI	371,264	4.550	1,689,251.20	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	50,276	56.000	2,815,456.00	
	KOC HOLDING AS	31,180	178.700	5,571,866.00	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	47,908	41.200	1,973,809.60	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	9,051	233.700	2,115,218.70	
	TURK HAVA YOLLARI AO	22,378	289.000	6,467,242.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	2,571	917.000	2,357,607.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	4,752	217.500	1,033,560.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	18,318	548.500	10,047,423.00	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	10,793	214.700	2,317,257.10	
	COCA-COLA ICECEK AS	39,039	67.400	2,631,228.60	
	AKBANK T.A.S.	126,956	58.050	7,369,795.80	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	46,491	93.000	4,323,663.00	
	TURKIYE IS BANKASI-C	396,383	12.950	5,133,159.85	
	YAPI VE KREDI BANKASI	148,083	29.860	4,421,758.38	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	48,118	95.850	4,612,110.30		
トルコ・リラ小計		1,460,394		73,311,450.37 (308,883,134)	
メキシコ・ ペソ	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	126,200	99.700	12,582,140.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	6,795	232.280	1,578,342.60	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	40,100	19.100	765,910.00	
	ALFA S.A.B. -A	126,300	11.130	1,405,719.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	24,300	114.830	2,790,369.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	15,935	336.760	5,366,270.60	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	7,585	518.890	3,935,780.65	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT	11,400	164.360	1,873,704.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	7,195	175.670	1,263,945.65	
	GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA	13,700	145.780	1,997,186.00	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	210,300	60.780	12,782,034.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	20,700	178.860	3,702,402.00	
	GRUMA S.A.B. -B	6,425	371.960	2,389,843.00	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	56,400	69.080	3,896,112.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	63,600	32.000	2,035,200.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	26,900	44.860	1,206,734.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	103,200	135.020	13,934,064.00	
GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	67,700	44.800	3,032,960.00		

	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER B	770,000	16.230	12,497,100.00	
	OPERADORA DE SITIOS MEX- A-1	47,400	16.210	768,354.00	
	メキシコ・ペソ小計	1,752,135		89,804,170.50 (647,730,541)	
フィリピン・ペソ	AYALA CORPORATION	11,640	612.000	7,123,680.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	116,262	24.350	2,830,979.70	
	SM INVESTMENTS CORP	9,035	920.000	8,312,200.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	41,320	402.000	16,610,640.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	19,650	252.000	4,951,800.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	27,990	90.700	2,538,693.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	75,036	125.000	9,379,500.00	
	BDO UNIBANK INC	92,674	159.500	14,781,503.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	84,590	75.400	6,378,086.00	
	PLDT INC	2,690	1,460.000	3,927,400.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	10,060	404.400	4,068,264.00	
	AYALA LAND INC	275,600	35.950	9,907,820.00	
SM PRIME HOLDINGS INC	404,100	30.550	12,345,255.00		
	フィリピン・ペソ小計	1,170,647		103,155,820.70 (262,263,359)	
チリ・ペソ	EMPRESAS CMPC SA	48,976	1,494.900	73,214,222.40	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	5,698	32,890.000	187,407,220.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	6,352,877	11.300	71,787,510.10	
	EMPRESAS COPEC SA	17,285	5,740.000	99,215,900.00	
	FALABELLA SA	34,870	3,071.000	107,085,770.00	
	CENCOSUD SA	53,544	1,799.000	96,325,656.00	
	BANCO DE CHILE	1,848,499	115.000	212,577,385.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	3,107	27,488.000	85,405,216.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	2,903,646	47.000	136,471,362.00	
	ENEL AMERICAS SA	843,379	91.750	77,380,023.25	
	ENEL CHILE SA	971,320	48.170	46,788,484.40	
	チリ・ペソ小計	13,083,201		1,193,658,749.15 (181,292,891)	
コロンビア・ペソ	BANCOLOMBIA SA	9,095	36,580.000	332,695,100.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	18,853	33,440.000	630,444,320.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	19,631	17,480.000	343,149,880.00	
	コロンビア・ペソ小計	47,579		1,306,289,300.00 (44,170,866)	
インド・ルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	57,472	347.800	19,988,761.60	
	COAL INDIA LTD	75,181	484.450	36,421,435.45	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	42,181	421.400	17,775,073.40	
	INDIAN OIL CORP LTD	106,892	175.340	18,742,443.28	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	125,071	298.900	37,383,721.90	
	OIL INDIA LTD	19,843	634.050	12,581,454.15	
	PETRONET LNG LTD	27,436	343.050	9,411,919.80	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	124,068	2,924.900	362,886,493.20		

AMBUJA CEMENTS LTD	24,411	630.150	15,382,591.65	
APL APOLLO TUBES LTD	6,265	1,398.500	8,761,602.50	
ASIAN PAINTS LTD	15,258	3,280.750	50,057,683.50	
GRASIM INDUSTRIES LTD	10,470	2,710.350	28,377,364.50	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	53,203	658.550	35,036,835.65	
JINDAL STAINLESS LTD	14,795	720.700	10,662,756.50	
JINDAL STEEL & POWER LTD	14,959	945.800	14,148,222.20	
JSW STEEL LTD	26,244	934.250	24,518,457.00	
NMDC LTD	43,717	207.670	9,078,709.39	
PI INDUSTRIES LTD	3,459	4,617.250	15,971,067.75	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	5,741	3,273.950	18,795,746.95	
SHREE CEMENT LTD	324	25,798.600	8,358,746.40	
SOLAR INDUSTRIES INDIA LTD	1,212	10,881.500	13,188,378.00	
SRF LTD	5,894	2,529.150	14,906,810.10	
SUPREME INDUSTRIES LTD	2,423	5,386.900	13,052,458.70	
TATA STEEL LTD	297,861	149.470	44,521,283.67	
ULTRATECH CEMENT LTD	4,814	11,494.350	55,333,800.90	
UPL LTD	15,397	604.400	9,305,946.80	
VEDANTA LTD	58,464	460.250	26,908,056.00	
ABB INDIA LTD	2,065	7,600.900	15,695,858.50	
ADANI ENTERPRISES LTD	6,462	2,964.150	19,154,337.30	
ASHOK LEYLAND LTD	56,114	243.900	13,686,204.60	
ASTRAL LTD	4,691	1,916.550	8,990,536.05	
BHARAT ELECTRONICS LTD	149,477	281.550	42,085,249.35	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	39,537	262.050	10,360,670.85	
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	23,122	664.150	15,356,476.30	
CUMMINS INDIA LTD	5,373	3,671.450	19,726,700.85	
HAVELLS INDIA LTD	9,425	1,892.400	17,835,870.00	
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	8,223	4,656.850	38,293,277.55	
LARSEN & TOUBRO LTD	27,749	3,578.300	99,294,246.70	
POLYCAB INDIA LTD	2,271	6,664.000	15,133,944.00	
RAIL VIKAS NIGAM LTD	23,469	562.900	13,210,700.10	
SIEMENS LTD	3,370	6,558.250	22,101,302.50	
SUZLON ENERGY LTD	405,457	74.340	30,141,673.38	
THERMAX LTD	1,883	4,323.650	8,141,432.95	
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	9,083	927.000	8,419,941.00	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	21,871	1,435.900	31,404,568.90	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	10,064	946.950	9,530,104.80	
GMR AIRPORTS INFRASTRUCTURE	104,248	90.890	9,475,100.72	
INTERGLOBE AVIATION LTD	7,201	4,808.500	34,626,008.50	
BAJAJ AUTO LTD	2,566	10,847.600	27,834,941.60	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	3,466	2,972.700	10,303,378.20	
BHARAT FORGE LTD	10,961	1,555.150	17,045,999.15	
BOSCH LTD	318	33,105.700	10,527,612.60	



EICHER MOTORS LTD	5,571	4,747.350	26,447,486.85	
HERO MOTOCORP LTD	5,124	5,745.300	29,438,917.20	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	37,574	2,708.850	101,782,329.90	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	5,221	12,145.750	63,412,960.75	
MRF LTD	88	133,979.300	11,790,178.40	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	116,035	187.360	21,740,317.60	
SONA BLW PRECISION FORGINGS	15,537	700.150	10,878,230.55	
TATA MOTORS LTD	82,248	1,038.700	85,430,997.60	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	4,025	3,896.850	15,684,821.25	
TVS MOTOR CO LTD	10,138	2,765.100	28,032,583.80	
DIXON TECHNOLOGIES INDIA LTD	1,437	12,401.450	17,820,883.65	
PAGE INDUSTRIES LTD	277	40,316.100	11,167,559.70	
TITAN CO LTD	14,492	3,684.550	53,396,498.60	
INDIAN HOTELS CO LTD	32,256	665.850	21,477,657.60	
JUBILANT FOODWORKS LTD	14,355	642.400	9,221,652.00	
ZOMATO LTD	263,052	263.200	69,235,286.40	
TRENT LTD	7,472	7,136.650	53,325,048.80	
AVENUE SUPERMARTS LTD	6,442	5,361.400	34,538,138.80	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	4,328	5,939.450	25,705,939.60	
ITC LTD	122,008	511.750	62,437,594.00	
MARICO LTD	23,047	676.000	15,579,772.00	
NESTLE INDIA LTD	13,199	2,516.750	33,218,583.25	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	24,849	1,192.050	29,621,250.45	
UNITED SPIRITS LTD	12,742	1,504.050	19,164,605.10	
VARUN BEVERAGES LTD	19,363	1,525.850	29,545,033.55	
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	5,865	3,681.800	21,593,757.00	
DABUR INDIA LTD	21,140	662.350	14,002,079.00	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	16,369	1,492.050	24,423,366.45	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	33,218	2,921.800	97,056,352.40	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	3,981	6,860.700	27,312,446.70	
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	32,458	882.400	28,640,939.20	
AUROBINDO PHARMA LTD	11,043	1,518.500	16,768,795.50	
CIPLA LTD	21,693	1,620.150	35,145,913.95	
DIVI'S LABORATORIES LTD	4,834	5,173.500	25,008,699.00	
DR. REDDY'S LABORATORIES	4,591	6,655.900	30,557,236.90	
LUPIN LTD	9,298	2,216.800	20,611,806.40	
MANKIND PHARMA LTD	4,543	2,411.950	10,957,488.85	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	38,994	1,821.850	71,041,218.90	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	3,991	3,431.100	13,693,520.10	
ZYDUS LIFESCENCES LTD	10,229	1,104.150	11,294,350.35	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	16,362	714.200	11,685,740.40	
AXIS BANK LTD	91,881	1,170.850	107,578,868.85	
BANK OF BARODA	38,009	235.550	8,953,019.95	
CANARA BANK	82,629	104.020	8,595,068.58	

HDFC BANK LIMITED	174,052	1,646.500	286,576,618.00	
ICICI BANK LTD	212,839	1,235.000	262,856,165.00	
IDFC FIRST BANK LTD	131,058	72.620	9,517,431.96	
INDUSIND BANK LTD	10,740	1,428.100	15,337,794.00	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	44,196	1,790.150	79,117,469.40	
PUNJAB NATIONAL BANK	83,349	109.630	9,137,550.87	
STATE BANK OF INDIA	72,455	784.250	56,822,833.75	
UNION BANK OF INDIA	56,109	120.080	6,737,568.72	
YES BANK LTD	625,769	22.890	14,323,852.41	
BAJAJ FINANCE LTD	11,259	7,347.450	82,724,939.55	
BAJAJ FINSERV LTD	16,333	1,860.450	30,386,729.85	
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	1,217	10,357.100	12,604,590.70	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	15,890	1,538.250	24,442,792.50	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	3,636	4,401.400	16,003,490.40	
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	117,174	341.700	40,038,355.80	
MUTHOOT FINANCE LTD	4,186	1,989.300	8,327,209.80	
POWER FINANCE CORPORATION	61,445	523.600	32,172,602.00	
REC LTD	55,630	590.050	32,824,481.50	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	10,068	802.350	8,078,059.80	
SHRIRAM FINANCE LTD	11,734	3,315.700	38,906,423.80	
SUNDARAM FINANCE LTD	2,718	4,828.400	13,123,591.20	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	41,129	735.800	30,262,718.20	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	9,130	2,232.400	20,381,812.00	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	12,502	758.150	9,478,391.30	
PB FINTECH LTD	12,666	1,741.200	22,054,039.20	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	19,037	1,901.750	36,203,614.75	
HCL TECHNOLOGIES LTD	37,770	1,746.750	65,974,747.50	
INFOSYS LTD	135,071	1,894.650	255,912,270.15	
LTIMINDTREE LTD	3,273	6,146.600	20,117,821.80	
MPHASIS LTD	4,655	2,993.700	13,935,673.50	
ORACLE FINANCIAL SERVICES	882	10,922.450	9,633,600.90	
PERSISTENT SYSTEMS LTD	4,385	5,168.750	22,664,968.75	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	37,071	4,449.550	164,949,268.05	
TATA ELXSI LTD	1,296	7,839.050	10,159,408.80	
TECH MAHINDRA LTD	21,364	1,579.200	33,738,028.80	
WIPRO LTD	53,173	514.850	27,376,119.05	
BHARTI AIRTEL LTD	105,011	1,542.650	161,995,219.15	
INDUS TOWERS LTD	52,261	421.500	22,028,011.50	
TATA COMMUNICATIONS LTD	4,533	1,925.850	8,729,878.05	
VODAFONE IDEA LTD	1,045,879	13.200	13,805,602.80	
ADANI GREEN ENERGY LTD	12,008	1,865.750	22,403,926.00	
ADANI POWER LTD	29,195	635.200	18,544,664.00	
GAIL INDIA LTD	87,099	217.750	18,965,807.25	
JSW ENERGY LTD	13,899	730.750	10,156,694.25	

	NHPC LTD	120,274	94.870	11,410,394.38	
	NTPC LTD	173,525	389.850	67,648,721.25	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	184,930	328.550	60,758,751.50	
	TATA POWER CO LTD	61,507	417.850	25,700,699.95	
	TORRENT POWER LTD	6,689	1,670.450	11,173,640.05	
	INFO EDGE INDIA LTD	2,865	7,418.600	21,254,289.00	
	DLF LTD	29,330	826.750	24,248,577.50	
	GODREJ PROPERTIES LTD	5,192	2,873.000	14,916,616.00	
	MACROTECH DEVELOPERS LTD	11,864	1,193.300	14,157,311.20	
	PHOENIX MILLS LTD	4,304	3,497.800	15,054,531.20	
	PRESTIGE ESTATES PROJECTS	6,459	1,801.050	11,632,981.95	
	インド・ルピー小計	7,485,614		5,322,438,304.01 (9,154,593,883)	
インドネシ ア・ルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBK P	658,700	3,490.000	2,298,863,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	65,100	27,250.000	1,773,975,000.00	
	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL	278,700	10,825.000	3,016,927,500.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	1,349,151	1,090.000	1,470,574,590.00	
	CHANDRA ASRI PACIFIC TBK PT	335,100	9,400.000	3,149,940,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	90,200	8,425.000	759,935,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	380,461	2,260.000	859,841,860.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	858,900	5,025.000	4,315,972,500.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	39,296,900	53.000	2,082,735,700.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	716,700	2,950.000	2,114,265,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	260,300	4,800.000	1,249,440,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	71,100	11,600.000	824,760,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	143,900	6,925.000	996,507,500.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	240,800	2,190.000	527,352,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	973,100	1,740.000	1,693,194,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	2,231,900	10,275.000	22,932,772,500.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	1,551,700	7,250.000	11,249,825,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	599,600	5,725.000	3,432,710,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	2,765,400	5,175.000	14,310,945,000.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	1,927,000	3,030.000	5,838,810,000.00	
	インドネシア・ルピア小計	54,794,712		84,899,346,150.00 (789,563,919)	
ブラジル・ リアル	COSAN SA	42,588	12.760	543,422.88	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	149,900	41.680	6,247,832.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	184,400	37.960	6,999,824.00	
	PRIO SA	34,500	41.960	1,447,620.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	26,800	23.790	637,572.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	20,900	11.470	239,723.00	
	GERDAU SA-PREF	50,928	18.500	942,168.00	
	SUZANO SA	31,215	54.120	1,689,355.80	
	VALE SA	139,888	56.680	7,928,851.84	

EMBRAER SA	30,500	48.040	1,465,220.00		
WEG SA	68,260	52.450	3,580,237.00		
CCR SA	46,500	13.230	615,195.00		
LOCALIZA RENT A CAR	35,730	41.550	1,484,581.50		
RUMO SA	56,700	21.300	1,207,710.00		
VIBRA ENERGIA SA	44,080	26.050	1,148,284.00		
ATACADAO SA	19,900	9.240	183,876.00		
RAIA DROGASIL SA	51,280	27.450	1,407,636.00		
SENDAS DISTRIBUIDORA SA	55,700	9.250	515,225.00		
AMBEV SA	199,000	13.110	2,608,890.00		
BRF SA	27,400	24.510	671,574.00		
JBS SA	29,700	33.900	1,006,830.00		
NATURA &CO HOLDING SA	38,000	13.600	516,800.00		
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	213,319	4.500	959,935.50		
REDE D'OR SAO LUIZ SA	33,700	33.450	1,127,265.00		
HYPERA SA	13,000	28.230	366,990.00		
BANCO BRADESCO S.A.	59,481	14.210	845,225.01		
BANCO BRADESCO SA-PREF	221,536	15.750	3,489,192.00		
BANCO DO BRASIL S.A.	71,200	29.130	2,074,056.00		
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	195,100	37.310	7,279,181.00		
ITAUSA SA	211,580	11.240	2,378,159.20		
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	231,600	12.300	2,848,680.00		
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	26,200	36.640	959,968.00		
CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACO	27,300	15.750	429,975.00		
TOTVS SA	22,800	29.210	665,988.00		
TELEFONICA BRASIL S.A.	16,800	54.190	910,392.00		
TIM SA	29,400	18.130	533,022.00		
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	47,305	41.740	1,974,510.70		
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	8,000	46.310	370,480.00		
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	68,508	11.850	811,819.80		
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	19,000	94.790	1,801,010.00		
COMPANHIA PARANAENSE -PREF B	51,700	10.830	559,911.00		
CPFL ENERGIA SA	7,300	34.470	251,631.00		
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	6,450	44.530	287,218.50		
EQUATORIAL ENERGIA SA	2,911	2.440	7,102.84		
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	49,900	34.640	1,728,536.00		
ブラジル・リアル小計	3,017,959		75,748,676.57 (1,945,968,351)		
チェコ・コ ルナ	KOMERCNI BANKA AS	2,663	769.500	2,049,178.50	
	MONETA MONEY BANK AS	12,093	111.000	1,342,323.00	
	CEZ AS	6,730	855.000	5,754,150.00	
チェコ・コルナ小計	21,486		9,145,651.50 (57,792,286)		
HD HYUNDAI	2,022	76,700.000	155,087,400.00		

韓国・ウ  
ン

SK INNOVATION CO LTD	2,672	108,100.000	288,843,200.00	
S-OIL CORP	1,775	58,600.000	104,015,000.00	
ENCHEM CO LTD	519	163,000.000	84,597,000.00	
HANWHA SOLUTIONS CORP	5,063	23,300.000	117,967,900.00	
HYUNDAI STEEL CO	2,767	24,350.000	67,376,450.00	
KOREA ZINC CO LTD	371	529,000.000	196,259,000.00	
KUM YANG CO LTD	1,245	43,300.000	53,908,500.00	
KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	531	142,500.000	75,667,500.00	
LG CHEM LTD	2,074	309,500.000	641,903,000.00	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	227	200,500.000	45,513,500.00	
LOTTE CHEMICAL CORP	723	79,000.000	57,117,000.00	
POSCO HOLDINGS INC	2,913	330,500.000	962,746,500.00	
SKC CO LTD	898	111,000.000	99,678,000.00	
DOOSAN BOBCAT INC	2,210	41,050.000	90,720,500.00	
DOOSAN ENERBILITY CO LTD	16,971	16,800.000	285,112,800.00	
ECOPRO BM CO LTD	1,920	151,600.000	291,072,000.00	
ECOPRO CO LTD	3,930	75,200.000	295,536,000.00	
ECOPRO MATERIALS CO LTD	616	95,100.000	58,581,600.00	
GS HOLDINGS	2,131	45,650.000	97,280,150.00	
HANWHA AEROSPACE CO LTD	1,363	290,000.000	395,270,000.00	
HANWHA OCEAN CO LTD	3,632	30,100.000	109,323,200.00	
HD HYUNDAI ELECTRIC CO LTD	930	245,500.000	228,315,000.00	
HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	830	177,900.000	147,657,000.00	
HD KOREA SHIPBUILDING & OFFS	1,607	170,600.000	274,154,200.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	2,816	30,300.000	85,324,800.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	3,106	50,900.000	158,095,400.00	
L&F CO LTD	1,068	87,200.000	93,129,600.00	
LG CORP	4,097	83,900.000	343,738,300.00	
LG ENERGY SOLUTION	1,956	399,500.000	781,422,000.00	
LS ELECTRIC CO LTD	737	136,800.000	100,821,600.00	
POSCO FUTURE M CO LTD	1,173	206,000.000	241,638,000.00	
POSCO INTERNATIONAL CORP	2,522	50,100.000	126,352,200.00	
SAMSUNG C&T CORP	3,755	145,300.000	545,601,500.00	
SAMSUNG E&A CO LTD	7,079	23,500.000	166,356,500.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	27,200	9,820.000	267,104,000.00	
SK INC	1,385	137,600.000	190,576,000.00	
SK SQUARE CO LTD	3,944	70,600.000	278,446,400.00	
HMM CO LTD	10,696	16,270.000	174,023,920.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,482	110,000.000	163,020,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	6,388	22,050.000	140,855,400.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	2,945	40,100.000	118,094,500.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	2,378	212,500.000	505,325,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	5,491	229,500.000	1,260,184,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	1,565	169,500.000	265,267,500.00	

HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	913	166,000.000	151,558,000.00	
KIA CORP	9,951	100,800.000	1,003,060,800.00	
COWAY CO LTD	1,996	67,200.000	134,131,200.00	
LG ELECTRONICS INC	4,419	103,400.000	456,924,600.00	
HANJIN KAL CORP	1,262	67,800.000	85,563,600.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	261	310,500.000	81,040,500.00	
KT&G CORP	4,383	109,700.000	480,815,100.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,190	88,800.000	105,672,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	1,133	139,300.000	157,826,900.00	
LG H&H	359	346,000.000	124,214,000.00	
HLB INC	4,671	90,400.000	422,258,400.00	
ALTEOGEN INC	1,692	304,500.000	515,214,000.00	
CELLTRION INC	6,183	192,100.000	1,187,754,300.00	
CELLTRION PHARM INC	857	67,500.000	57,847,500.00	
HANMI PHARM CO LTD	246	315,500.000	77,613,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	745	965,000.000	718,925,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	1,453	104,400.000	151,693,200.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	902	52,200.000	47,084,400.00	
YUHAN CORP	2,342	119,900.000	280,805,800.00	
HANA FINANCIAL GROUP	11,955	61,200.000	731,646,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	11,154	13,750.000	153,367,500.00	
KAKAOBANK CORP	6,317	20,150.000	127,287,550.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	15,500	82,300.000	1,275,650,000.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	17,971	56,100.000	1,008,173,100.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	26,970	15,770.000	425,316,900.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	1,369	70,100.000	95,966,900.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	3,907	89,900.000	351,239,300.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	8,457	8,340.000	70,531,380.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	5,391	13,490.000	72,724,590.00	
DB INSURANCE CO LTD	1,789	113,000.000	202,157,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	1,227	345,500.000	423,928,500.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	3,201	94,600.000	302,814,600.00	
POSCO DX CO LTD	1,864	25,700.000	47,904,800.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	1,822	155,000.000	282,410,000.00	
COSMOAM&T CO LTD	821	99,500.000	81,689,500.00	
LG DISPLAY CO LTD	11,601	10,720.000	124,362,720.00	
LG INNOTEK CO LTD	495	237,500.000	117,562,500.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	2,356	132,900.000	313,112,400.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	194,488	67,500.000	13,127,940,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	33,810	55,400.000	1,873,074,000.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	2,241	344,000.000	770,904,000.00	
HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	1,863	97,600.000	181,828,800.00	
SK HYNIX INC	22,327	157,000.000	3,505,339,000.00	
KT CORP	1,784	41,400.000	73,857,600.00	

	LG UPLUS CORP	6,942	9,890.000	68,656,380.00	
	SK TELECOM	2,212	56,500.000	124,978,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	9,785	21,750.000	212,823,750.00	
	HYBE CO LTD	801	165,000.000	132,165,000.00	
	KAKAO CORP	12,106	34,000.000	411,604,000.00	
	KRAFTON INC	1,234	328,000.000	404,752,000.00	
	NAVER CORP	5,285	155,000.000	819,175,000.00	
	NCSOFT CORP	485	178,200.000	86,427,000.00	
	NETMARBLE CORP	1,568	57,500.000	90,160,000.00	
	韓国・ウォン小計	627,779		45,560,611,590.00 (4,865,873,318)	
マレーシア・リンギット	PETRONAS DAGANGAN BHD	10,400	19.280	200,512.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	105,000	5.470	574,350.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	140,100	4.680	655,668.00	
	GAMUDA BHD	84,800	7.350	623,280.00	
	SIME DARBY BERHAD	93,800	2.330	218,554.00	
	SUNWAY BHD	92,600	3.960	366,696.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	30,900	10.200	315,180.00	
	MISC BHD	61,600	8.050	495,880.00	
	GENTING BHD	78,200	4.170	326,094.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	124,300	2.430	302,049.00	
	MR DIY GROUP M BHD	136,150	1.990	270,938.50	
	IOI CORP BHD	101,000	3.830	386,830.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	21,300	21.040	448,152.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	2,300	102.700	236,210.00	
	PPB GROUP BERHAD	30,140	14.300	431,002.00	
	QL RESOURCES BHD	54,350	6.730	365,775.50	
	SD GUTHRIE BHD	80,400	4.500	361,800.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	85,700	6.720	575,904.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	108,500	5.150	558,775.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	286,100	8.280	2,368,908.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	22,700	20.940	475,338.00	
	MALAYAN BANKING BHD	227,100	10.900	2,475,390.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	605,200	4.800	2,904,960.00	
	RHB BANK BHD	73,100	6.210	453,951.00	
	INARI AMERTRON BHD	125,200	2.970	371,844.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	89,500	2.420	216,590.00	
	CELCOMDIGI BHD	123,800	3.710	459,298.00	
MAXIS BHD	85,300	3.770	321,581.00		
TELEKOM MALAYSIA BHD	56,700	6.620	375,354.00		
PETRONAS GAS BHD	30,700	18.020	553,214.00		
TENAGA NASIONAL BHD	104,400	14.640	1,528,416.00		
YTL CORP BHD	149,000	2.390	356,110.00		
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	108,600	3.370	365,982.00		

マレーシア・リンギット小計		3,528,940		20,940,586.00 (687,810,300)	
南アフリ カ・ランド	EXXARO RESOURCES LTD	11,192	153.300	1,715,733.60	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	2,321	577.700	1,340,841.70	
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	16,779	508.600	8,533,799.40	
	GOLD FIELDS LTD	36,395	240.510	8,753,361.45	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	23,472	159.000	3,732,048.00	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	38,529	71.370	2,749,814.73	
	KUMBA IRON ORE LTD	2,544	320.890	816,344.16	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	14,047	90.370	1,269,427.39	
	SASOL LTD	24,977	124.000	3,097,148.00	
	SIBANYE STILLWATER LTD	119,878	15.220	1,824,543.16	
	BIDVEST GROUP LTD	14,536	277.380	4,031,995.68	
	NASPERS LTD-N SHS	7,250	3,549.280	25,732,280.00	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	97,392	21.540	2,097,823.68	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	38,194	63.740	2,434,485.56	
	BID CORP LTD	13,980	445.260	6,224,734.80	
	CLICKS GROUP LTD	9,867	370.260	3,653,355.42	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	21,011	297.640	6,253,714.04	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	15,681	193.140	3,028,628.34	
	ABSA GROUP LTD	34,551	171.940	5,940,698.94	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,583	2,954.250	10,585,077.75	
	NEDBANK GROUP LTD	19,433	282.870	5,497,012.71	
	STANDARD BANK GROUP LTD	54,772	234.080	12,821,029.76	
	FIRSTRAND LTD	204,749	85.360	17,477,374.64	
	REINET INVESTMENTS SCA	4,918	485.880	2,389,557.84	
REMGRO LTD	19,028	144.650	2,752,400.20		
DISCOVERY LTD	22,003	150.490	3,311,231.47		
OLD MUTUAL LTD	170,915	12.820	2,191,130.30		
OUTSURANCE GROUP LTD	34,388	50.400	1,733,155.20		
SANLAM LTD	70,266	84.400	5,930,450.40		
MTN GROUP LTD	67,043	91.550	6,137,786.65		
VODACOM GROUP LTD	25,348	110.880	2,810,586.24		
NEPI ROCKCASTLE N.V.	23,182	147.840	3,427,226.88		
南アフリカ・ランド小計		1,262,224		170,294,798.09 (1,364,061,333)	
タイ・パー ツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	56,500	144.000	8,136,000.00	
	PTT PCL-NVDR	391,900	34.250	13,422,575.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	52,500	55.000	2,887,500.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	78,600	28.000	2,200,800.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	41,600	28.500	1,185,600.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	31,300	247.000	7,731,100.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	178,800	62.500	11,175,000.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR	348,900	8.000	2,791,200.00	



	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	126,300	28.750	3,631,125.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	63,391	32.250	2,044,359.75	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	235,400	10.700	2,518,780.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	110,600	17.200	1,902,320.00	
	CP ALL PCL-NVDR	229,200	66.000	15,127,200.00	
	CP AXTRA PCL-NVDR	77,100	32.500	2,505,750.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	154,600	25.000	3,865,000.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	455,100	29.500	13,425,450.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	22,300	273.000	6,087,900.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	23,700	155.500	3,685,350.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	171,100	20.400	3,490,440.00	
	SCB X PCL-NVDR	30,600	112.000	3,427,200.00	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	1,077,800	2.020	2,177,156.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	50,200	45.000	2,259,000.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	130,500	101.500	13,245,750.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	49,900	260.000	12,974,000.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	35,900	88.750	3,186,125.00	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	474,567	10.500	4,982,953.50	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	130,000	55.500	7,215,000.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	76,200	65.000	4,953,000.00	
	タイ・パーツ小計	4,904,558		162,233,634.25 (686,248,273)	
ポーランド・ズロチ	ORLEN SA	23,604	61.410	1,449,521.64	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	5,950	133.400	793,730.00	
	BUDIMEX	546	573.000	312,858.00	
	LPP SA	48	14,140.000	678,720.00	
	ALLEGRO.EU SA	23,505	35.925	844,417.12	
	DINO POLSKA SA	1,969	311.300	612,949.70	
	ALIOR BANK SA	4,307	95.200	410,026.40	
	BANK PEKAO SA	7,306	153.750	1,123,297.50	
	MBANK SA	477	623.800	297,552.60	
	PKO BANK POLSKI SA	36,275	56.860	2,062,596.50	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	1,451	506.600	735,076.60	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	23,952	46.880	1,122,869.76	
	PGE SA	36,813	7.086	260,856.91	
	CD PROJEKT SA	2,415	166.200	401,373.00	
	ポーランド・ズロチ小計	168,618		11,105,845.73 (411,212,818)	
ハンガリー・フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	17,123	2,632.000	45,067,736.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	5,767	10,630.000	61,303,210.00	
	OTP BANK PLC	8,992	18,165.000	163,339,680.00	
	ハンガリー・フォリント小計	31,882		269,710,626.00 (107,604,291)	
ユーロ	METLEN ENERGY & METALS SA	4,436	33.760	149,759.36	
	FF GROUP	123	4.800	590.40	

OPAP SA	7,358	15.980	117,580.84	
JUMBO SA	4,834	24.200	116,982.80	
ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	91,747	1.540	141,290.38	
EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	105,462	2.012	212,189.54	
NATIONAL BANK OF GREECE	32,591	7.546	245,931.68	
PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS S	40,213	3.980	160,047.74	
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	7,649	15.000	114,735.00	
PUBLIC POWER CORP	8,551	11.640	99,533.64	
ユーロ小計	302,964		1,358,641.38 (215,113,690)	
合計	140,266,314		38,999,228,042 (38,999,228,042)	

(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	22銘柄	2.5%	3.0%
香港・ドル	株式	151銘柄	17.6%	20.9%
台湾・ドル	株式	87銘柄	17.1%	20.3%
エジプト・ポンド	株式	3銘柄	0.1%	0.1%
トルコ・リラ	株式	18銘柄	0.7%	0.8%
メキシコ・ペソ	株式	20銘柄	1.4%	1.7%
フィリピン・ペソ	株式	13銘柄	0.6%	0.7%
チリ・ペソ	株式	11銘柄	0.4%	0.5%
コロンビア・ペソ	株式	3銘柄	0.1%	0.1%
インド・ルピー	株式	151銘柄	19.8%	23.5%
インドネシア・ルピア	株式	20銘柄	1.7%	2.0%
ブラジル・リアル	株式	45銘柄	4.2%	5.0%
チェコ・コルナ	株式	3銘柄	0.1%	0.1%
韓国・ウォン	株式	98銘柄	10.5%	12.5%
マレーシア・リングgit	株式	33銘柄	1.5%	1.8%
南アフリカ・ランド	株式	32銘柄	2.9%	3.5%
タイ・バーツ	株式	28銘柄	1.5%	1.8%
ポーランド・ズロチ	株式	14銘柄	0.9%	1.1%
ハンガリー・フォリント	株式	3銘柄	0.2%	0.3%
ユーロ	株式	10銘柄	0.5%	0.6%

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オフショア・人民元	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	2,368,000.00	77,907,200.00	
		オフショア・人民元小計	2,368,000.00	77,907,200.00 (1,569,128,915)	
投資信託受益証券合計				1,569,128,915 (1,569,128,915)	

投資証券	アメリカ・ドル	ISHARES MSCI KUWAIT ETF	70,532.00	2,300,824.37		
		ISHARES MSCI QATAR ETF	141,785.00	2,519,519.45		
		ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	299,238.00	12,514,133.16		
		ISHARES MSCI UAE ETF	256,688.00	3,863,154.40		
	アメリカ・ドル小計		768,243.00	21,197,631.38	(3,042,496,032)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB-CPO	642,700.00	7,256,083.00		
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	20,875.00	3,536,016.25		
		FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	74,500.00	15,145,105.00		
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	45,560.00	2,926,318.80		
		TRUST FIBRA UNO	117,000.00	2,707,380.00		
	メキシコ・ペソ小計		900,635.00	31,570,903.05	(227,711,452)	
	ブラジル・レアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	49,300.00	1,754,587.00		
		ENERGISA SA-UNITS	11,000.00	527,780.00		
		KLABIN SA - UNIT	34,430.00	745,065.20		
	ブラジル・レアル小計		94,730.00	3,027,432.20	(77,774,128)	
投資証券合計				3,347,981,612	(3,347,981,612)	
合 計				4,917,110,527	(4,917,110,527)	

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

通貨	銘柄数		組入 投資信託受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券	4銘柄	-	6.6%	61.9%
メキシコ・ペソ	投資証券	5銘柄	-	0.5%	4.6%
ブラジル・レアル	投資証券	3銘柄	-	0.2%	1.6%
オフショア・人民元	投資信託受益証券	1銘柄	3.4%	-	31.9%

#### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

#### Jリート・インデックス・マザーファンド

##### (1) 貸借対照表

(単位：円)

(2024年9月10日現在)

#### 資産の部

##### 流動資産

金銭信託	443,291
コール・ローン	82,373,038
投資証券	15,471,272,450
未収入金	1,111,200
未収配当金	236,616,657

差入委託証拠金	2,192,716
流動資産合計	15,794,009,352
資産合計	15,794,009,352
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	72,400
前受金	710,000
未払金	37,512,344
未払解約金	8,719,063
流動負債合計	47,013,807
負債合計	47,013,807
純資産の部	
元本等	
元本	6,014,675,226
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	9,732,320,319
元本等合計	15,746,995,545
純資産合計	15,746,995,545
負債純資産合計	15,794,009,352

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年9月12日 至 2024年9月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2024年9月10日現在)
1. 当計算期間の末日における 受益権の総数	6,014,675,226口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.6181円 (1万口当たりの純資産額26,181円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年9月12日 至 2024年9月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2024年9月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2024年9月10日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引	リート指数先物取引 買建				
	TREIT 先物 0612月	35,002,400	-	34,930,000	72,400
	小計	35,002,400	-	34,930,000	72,400
合 計		35,002,400	-	34,930,000	72,400

## (注) 1. 時価の算定方法

リート指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2)リート指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

自 2023年9月12日 至 2024年9月10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9月10日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	4,995,462,169円
同期中における追加設定元本額	2,863,595,536円
同期中における一部解約元本額	1,844,382,479円
2024年9月10日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	63,216,801円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	143,794,181円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	104,273,357円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	2,803,578,293円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	32,189,464円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	48,821,857円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	52,586,537円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	239,482,273円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	156,128,374円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	127,306,138円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	61,188,113円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	4,457,083円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	395,187,106円
日興FWS・Jリートインデックス	1,127,386,898円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	190,743,278円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	5,925,211円

三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	4,051,971円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	5,631,276円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	3,579,116円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	2,152,346円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	415,601円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	17,976,952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)	95,461,417円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	102,437,174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)	40,255,217円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	2,641,141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>	69,740,411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>	43,842,620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>	70,225,020円
合計	6,014,675,226円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	338	39,782,600	
	サンケイリアルエステート投資法人	487	38,667,800	
	SOSILA物流リート投資法人	759	87,057,300	
	東海道リート投資法人	258	29,515,200	
	日本アコモデーションファンド投資法人	524	346,364,000	
	森ヒルズリート投資法人	1,789	227,024,100	
	産業ファンド投資法人	2,785	337,820,500	
	アドバンス・レジデンス投資法人	1,495	501,572,500	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	740	246,420,000	
	GLP投資法人	5,109	683,073,300	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	769	254,154,500	
	日本プロロジスリート投資法人	2,650	730,075,000	
	星野リゾート・リート投資法人	320	154,400,000	
	Oneリート投資法人	265	65,534,500	
	イオンリート投資法人	1,866	250,603,800	
	ヒューリックリート投資法人	1,343	187,079,900	
	日本リート投資法人	494	156,104,000	
	積水ハウス・リート投資法人	4,572	371,703,600	
トーセイ・リート投資法人	331	45,446,300		
ヘルスケア&メディカル投資法人	376	44,443,200		



サムティ・レジデンシャル投資法人	391	39,256,400	
野村不動産マスターファンド投資法人	4,918	746,060,600	
いちごホテルリート投資法人	250	30,850,000	
ラサールロジポート投資法人	1,948	280,317,200	
スターアジア不動産投資法人	2,802	149,066,400	
マリモ地方創生リート投資法人	275	32,340,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	635	275,907,500	
日本ホテル&レジデンシャル投資法人	244	17,080,000	
投資法人みらい	2,095	91,656,250	
三菱地所物流リート投資法人	525	197,662,500	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	655	97,988,000	
ザイマックス・リート投資法人	259	29,681,400	
タカラレーベン不動産投資法人	855	75,753,000	
タカラレーベン不動産投 新	81	7,176,600	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	667	83,241,600	
日本ビルファンド投資法人	1,774	1,206,320,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	1,561	935,039,000	
日本都市ファンド投資法人	7,663	763,234,800	
オリックス不動産投資法人	3,032	465,108,800	
日本プライムリアルティ投資法人	1,041	364,870,500	
N T T 都市開発リート投資法人	1,547	178,523,800	
東急リアル・エステート投資法人	1,021	150,291,200	
グローバル・ワン不動産投資法人	1,123	113,310,700	
ユナイテッド・アーバン投資法人	3,403	472,676,700	
森トラストリート投資法人	2,932	188,234,400	
インヴィンシブル投資法人	8,381	492,802,800	
フロンティア不動産投資法人	563	243,216,000	
平和不動産リート投資法人	1,115	143,500,500	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,023	277,539,900	
福岡リート投資法人	815	116,871,000	
福岡リート新	43	6,166,200	
K D X 不動産投資法人	4,256	661,382,400	
いちごオフィスリート投資法人	1,109	92,157,900	
大和証券オフィス投資法人	621	193,131,000	
阪急阪神リート投資法人	726	90,967,800	
スターツプロシード投資法人	263	50,574,900	
大和ハウスリート投資法人	2,279	538,755,600	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	5,588	390,601,200	
大和証券リビング投資法人	2,203	223,824,800	
ジャパンエクセレント投資法人	1,306	161,291,000	

投資証券 小計	15,471,272,450
合計	15,471,272,450

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

## 外国リート・インデックス・マザーファンド

## ( 1 ) 貸借対照表

( 単位：円 )

( 2024年9月10日現在 )

資産の部	
流動資産	
預金	1,251,471,576
金銭信託	276,585
コール・ローン	51,395,489
投資証券	39,464,774,666
派生商品評価勘定	326,914
未収入金	2,608,348
未収配当金	74,746,383
流動資産合計	40,845,599,961
資産合計	40,845,599,961
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	57,500
未払解約金	756,716
流動負債合計	814,216
負債合計	814,216
純資産の部	
元本等	
元本	11,482,382,596
剰余金	
剰余金又は欠損金 ( )	29,362,403,149
元本等合計	40,844,785,745
純資産合計	40,844,785,745
負債純資産合計	40,845,599,961

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項目	自 2023年9月12日 至 2024年9月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	(2024年9月10日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	11,482,382,596口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.5572円 (1万口当たりの純資産額35,572円)

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2023年9月12日 至 2024年9月10日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券</p> <p>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引</p> <p>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p>

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

### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2024年9月10日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資証券）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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9月10日現在)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	54,200,000	-	54,372,715	172,715
	香港・ドル	5,400,000	-	5,426,340	26,340
	イギリス・ポンド	10,200,000	-	10,167,340	32,660
	ユーロ	5,000,000	-	4,975,430	24,570
	小計	74,800,000	-	74,941,825	141,825
	売建				
	オーストラリア・ドル	11,300,000	-	11,172,411	127,589
	小計	11,300,000	-	11,172,411	127,589
合計		86,100,000	-	86,114,236	269,414

## (注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

自 2023年9月12日 至 2024年9月10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9月10日現在)
----------------

開示対象ファンドの		
期首における当該親投資信託の元本額		9,979,027,630円
同期中における追加設定元本額		2,477,079,301円
同期中における一部解約元本額		973,724,335円
2024年9月10日現在の元本の内訳		
アセットアロケーション・ファンド(安定型)		9,287,763円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)		14,066,046円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)		8,047,360円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド		8,969,883,985円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050		11,148,089円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)		38,740,973円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)		38,588,464円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)		167,348,435円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)		112,510,735円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)		94,715,195円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド		132,220,140円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060		1,569,833円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド		441,971,249円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)		62,020,189円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)		1,119,894,988円
三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド		153,468,162円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035		3,658,052円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040		2,015,595円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045		2,148,597円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055		1,193,093円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065		730,370円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)		60,300円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)		1,108,014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)		6,189,308円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)		6,844,237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)		2,761,958円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>		28,476,244円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>		51,715,222円
合計		11,482,382,596円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	20,375.00	455,177.50	
		AGREE REALTY CORP	17,601.00	1,343,484.33	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	12,195.00	234,144.00	
		ALEXANDER'S INC	300.00	69,243.00	

ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	28,835.00	3,409,738.75	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	2,165.00	40,507.15	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	10,429.00	266,043.79	
AMERICAN HEALTHCARE REIT INC	14,873.00	333,155.20	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	59,403.00	2,328,003.57	
AMERICOLD REALTY TRUST INC	48,007.00	1,411,405.80	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	23,200.00	203,000.00	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	40,321.00	567,316.47	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	15,799.00	186,270.21	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	2,515.00	2,135.23	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	25,857.00	5,830,494.93	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	8,400.00	23,856.00	
BRANDYWINE REALTY TRUST	34,607.00	173,727.14	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	54,159.00	1,483,415.01	
BROADSTONE NET LEASE INC	31,774.00	581,146.46	
BRT APARTMENTS CORP	500.00	9,085.00	
BXP INC	26,897.00	1,998,447.10	
CAMDEN PROPERTY TRUST	19,215.00	2,331,163.80	
CARETRUST REIT INC	24,090.00	720,772.80	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	3,648.00	92,914.56	
CENTERSPACE	2,600.00	192,712.00	
CHATHAM LODGING TRUST	12,827.00	104,540.05	
CITY OFFICE REIT INC	4,603.00	26,605.34	
CLIPPER REALTY INC	800.00	3,872.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3,216.00	51,166.56	
COPT DEFENSE PROPERTIES	20,034.00	584,992.80	
COUSINS PROPERTIES INC	28,470.00	808,263.30	
CTO REALTY GROWTH INC	3,839.00	74,937.28	
CUBESMART	40,256.00	2,091,701.76	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	33,165.00	275,601.15	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	178,800.00	106,386.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	58,588.00	8,749,531.92	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	23,884.00	77,145.32	
DOUGLAS EMMETT INC	30,537.00	479,125.53	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	20,000.00	2,740.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	15,924.00	211,470.72	
EASTGROUP PROPERTIES INC	8,959.00	1,667,628.26	
ELME COMMUNITIES	15,190.00	265,369.30	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	21,276.00	217,015.20	
EPR PROPERTIES	12,612.00	601,087.92	
EQUINIX INC	17,094.00	14,218,789.20	
EQUITY COMMONWEALTH	17,598.00	356,887.44	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	34,434.00	2,555,002.80	
EQUITY RESIDENTIAL	62,983.00	4,730,023.30	

ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	32,895.00	1,062,508.50	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,550.00	3,465,577.50	
EXTRA SPACE STORAGE INC	38,227.00	6,679,785.98	
FARMLAND PARTNERS INC	7,194.00	72,731.34	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	13,176.00	1,543,173.12	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	22,908.00	1,292,927.52	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	17,953.00	531,049.74	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	15,115.00	24,486.30	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	49,019.00	2,554,380.09	
GETTY REALTY CORP	10,369.00	328,282.54	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5,368.00	82,130.40	
GLADSTONE LAND CORP	4,464.00	60,755.04	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	12,642.00	114,536.52	
GLOBAL NET LEASE INC	30,518.00	265,811.78	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	69,152.00	1,244,044.48	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	128,507.00	2,843,859.91	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	19,816.00	626,581.92	
HOST HOTELS & RESORTS INC	130,084.00	2,181,508.68	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	17,289.00	82,295.64	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	42,537.00	841,381.86	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	6,274.00	29,676.02	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	5,313.00	651,851.97	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	11,866.00	347,199.16	
INVITATION HOMES INC	103,209.00	3,683,529.21	
IRON MOUNTAIN INC	52,925.00	5,842,390.75	
JBG SMITH PROPERTIES	14,792.00	255,753.68	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	130,900.00	32,070.50	
KILROY REALTY CORP	19,409.00	670,386.86	
KIMCO REALTY CORP	117,891.00	2,745,681.39	
KITE REALTY GROUP TRUST	38,279.00	992,574.47	
LINEAGE INC	10,282.00	851,452.42	
LTC PROPERTIES INC	7,251.00	265,386.60	
LXP INDUSTRIAL TRUST	52,073.00	525,937.30	
MACERICH CO/THE	38,484.00	590,729.40	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	245,900.00	23,606.40	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	97,588.00	486,964.12	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	21,016.00	3,368,864.80	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	13,122.00	614,240.82	
NATL HEALTH INVESTORS INC	7,193.00	593,854.08	
NET LEASE OFFICE PROPERTY	2,275.00	67,021.50	
NETSTREIT CORP	13,768.00	232,266.16	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	7,980.00	43,969.80	
NEXPOINT RESIDENTIAL	3,529.00	157,640.43	
NNN REIT INC	32,073.00	1,560,351.45	



OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	9,538.00	20,411.32	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	45,355.00	1,811,478.70	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,352.00	62,633.76	
ORION OFFICE REIT INC	8,094.00	31,566.60	
PARAMOUNT GROUP INC	23,577.00	113,876.91	
PARK HOTELS & RESORTS INC	35,722.00	502,965.76	
PEAKSTONE REALTY TRUST	7,728.00	105,023.52	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	20,329.00	254,722.37	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	22,600.00	849,082.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	19,902.00	187,675.86	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	8,798.00	201,034.30	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	1,424.00	20,576.80	
PRIME US REIT	143,770.00	26,309.91	
PROLOGIS INC	167,586.00	21,828,076.50	
PUBLIC STORAGE	28,551.00	10,035,676.50	
REALTY INCOME CORP	158,136.00	9,940,428.96	
REGENCY CENTERS CORP	30,479.00	2,268,856.76	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	22,092.00	331,159.08	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	39,699.00	1,979,392.14	
RLJ LODGING TRUST	24,132.00	215,740.08	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	10,529.00	1,047,530.21	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	44,231.00	768,292.47	
SAFEHOLD INC	10,598.00	261,134.72	
SAUL CENTERS INC	2,331.00	93,379.86	
SERVICE PROPERTIES TRUST	37,820.00	174,728.40	
SIMON PROPERTY GROUP INC	59,090.00	9,568,443.70	
SITE CENTERS CORP	8,123.00	461,061.48	
SL GREEN REALTY CORP	11,643.00	729,899.67	
STAG INDUSTRIAL INC	32,025.00	1,266,268.50	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	14,098.00	89,240.34	
SUN COMMUNITIES INC	22,550.00	3,157,000.00	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	39,745.00	390,693.35	
TANGER INC	20,789.00	639,469.64	
TERRENO REALTY CORP	17,748.00	1,211,833.44	
UDR INC	55,893.00	2,488,356.36	
UMH PROPERTIES INC	11,316.00	221,567.28	
UNITI GROUP INC	46,029.00	238,890.51	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,344.00	59,539.20	
URBAN EDGE PROPERTIES	20,402.00	420,281.20	
VENTAS INC	72,232.00	4,634,405.12	
VERIS RESIDENTIAL INC	16,966.00	290,797.24	
VICI PROPERTIES INC	188,053.00	6,367,474.58	
VORNADO REALTY TRUST	27,687.00	923,361.45	
WELLTOWER INC	108,411.00	13,803,972.63	

	WHITESTONE REIT	12,068.00	156,763.32	
	WP CAREY INC	39,026.00	2,405,172.38	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	17,827.00	237,277.37	
	アメリカ・ドル小計	4,693,467.00	215,971,973.35 (30,998,457,335)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	14,869.00	251,732.17	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	9,662.00	72,851.48	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4,788.00	420,577.92	
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	3,187.00	58,035.27	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	6,841.00	23,122.58	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,077.00	747,770.24	
	CHOICE PROPERTIES REIT	30,541.00	455,366.31	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	10,639.00	162,138.36	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	9,193.00	142,031.85	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	23,474.00	324,645.42	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2,732.00	54,202.88	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	21,618.00	387,826.92	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	5,260.00	405,335.60	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	21,001.00	225,970.76	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11,198.00	139,527.08	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	8,107.00	166,923.13	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,447.00	23,528.22	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1,557.00	28,539.81	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	4,345.00	36,889.05	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	20,754.00	104,185.08	
	PRIMARIS REIT	6,318.00	96,033.60	
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	15,604.00	85,978.04	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	24,676.00	478,467.64	
SLATE GROCERY REIT-CL U	3,196.00	40,844.88		
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	12,000.00	311,280.00		
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	829.00	9,550.08		
	カナダ・ドル小計	287,913.00	5,253,354.37 (555,699,825)	
オーストラリア・ドル	ABACUS GROUP	50,980.00	64,999.50	
	ABACUS STORAGE KING	145,482.00	184,034.73	
	ARENA REIT	80,503.00	326,842.18	
	BWP TRUST	115,823.00	423,912.18	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	160,667.00	274,740.57	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	84,443.00	268,528.74	
	CENTURIA OFFICE REIT	68,559.00	78,500.05	
	CHARTER HALL GROUP	83,440.00	1,310,842.40	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	134,611.00	527,675.12	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	91,686.00	335,570.76	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	72,491.00	198,625.34	

	CROMWELL PROPERTY GROUP	218,718.00	87,487.20	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	30,237.00	84,361.23	
	DEXUS/AU	190,461.00	1,430,362.11	
	GDI PROPERTY GROUP	83,204.00	52,002.50	
	GOODMAN GROUP	314,107.00	10,500,597.01	
	GPT GROUP	330,937.00	1,687,778.70	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	52,361.00	132,996.94	
	HEALTHCO REIT	51,410.00	61,177.90	
	HMC CAPITAL LTD	53,344.00	423,017.92	
	HOMEKO DAILY NEEDS REIT	332,002.00	424,962.56	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	55,080.00	205,999.20	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	62,840.00	329,281.60	
	MIRVAC GROUP	701,595.00	1,543,509.00	
	NATIONAL STORAGE REIT	208,817.00	513,689.82	
	REGION RE LTD	191,819.00	429,674.56	
	RURAL FUNDS GROUP	52,739.00	106,005.39	
	SCENTRE GROUP	960,992.00	3,411,521.60	
	STOCKLAND	416,620.00	2,166,424.00	
	VICINITY CENTRES	664,812.00	1,522,419.48	
	WAYPOINT REIT	113,111.00	303,137.48	
	オーストラリア・ドル小計	6,173,891.00	29,410,677.77 (2,807,249,193)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	435,000.00	787,350.00	
	FORTUNE REIT	259,000.00	1,069,670.00	
	LINK REIT	449,900.00	16,758,775.00	
	PROSPERITY REIT	312,000.00	414,960.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	202,000.00	369,660.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	494,000.00	474,240.00	
	香港・ドル小計	2,151,900.00	19,874,655.00 (365,693,652)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT	113,300.00	148,423.00	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	654,700.00	1,892,083.00	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	428,155.00	396,043.37	
	CAPITALAND CHINA TRUST	205,700.00	149,132.50	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	956,708.00	2,018,653.88	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	159,550.00	149,977.00	
	EC WORLD REIT	52,800.00	14,784.00	
	ESR-LOGOS REIT	1,097,413.00	307,275.64	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	190,000.00	122,550.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	221,100.00	530,640.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC	527,638.00	601,507.32	
	KEPPEL DC REIT	258,900.00	559,224.00	
	KEPPEL REIT	363,300.00	334,236.00	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	262,000.00	158,510.00	

	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	363,300.00	908,250.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	558,250.00	792,715.00	
	MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	446,000.00	628,860.00	
	PARAGON REIT	215,200.00	186,148.00	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	69,800.00	272,918.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	66,700.00	45,022.50	
	STARHILL GLOBAL REIT	195,000.00	101,400.00	
	SUNTEC REIT	416,400.00	528,828.00	
	シンガポール・ドル小計	7,821,914.00	10,847,181.21 (1,191,237,440)	
ニュージー ランド・ド ル	ARGOSY PROPERTY LTD	153,482.00	178,806.53	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	211,264.00	444,710.72	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	264,918.00	251,672.10	
	PRECINCT PROPERTIES GROUP	269,326.00	348,777.17	
	ニュージーランド・ドル小計	898,990.00	1,223,966.52 (107,745,773)	
イギリス・ ポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	53,280.00	30,049.92	
	AEW UK REIT PLC	9,000.00	8,856.00	
	ASSURA PLC	472,915.00	191,530.57	
	BALANCED COMM PROPERTY TRUST	154,750.00	147,012.50	
	BIG YELLOW GROUP PLC	35,499.00	464,326.92	
	BRITISH LAND CO PLC	162,562.00	708,120.07	
	CLS HOLDINGS PLC	41,598.00	37,188.61	
	CUSTODIAN PROPERTY INCOME RE	84,958.00	69,665.56	
	DERWENT LONDON PLC	20,725.00	494,913.00	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	95,000.00	92,625.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	71,900.00	251,290.50	
	HAMMERSON PLC	740,000.00	216,080.00	
	HELICAL PLC	17,000.00	39,270.00	
	HOME REIT PLC	96,051.00	36,499.38	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	88,651.00	79,697.24	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	141,683.00	926,606.82	
	LIFE SCIENCE REIT PLC	104,502.00	34,381.15	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	367,037.00	742,148.81	
	NEWRIVER REIT PLC	46,021.00	36,448.63	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	153,900.00	114,501.60	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	270,348.00	269,266.60	
	PRS REIT PLC/THE	89,207.00	84,389.82	
	REGIONAL REIT LTD	15,921.00	20,299.27	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	41,662.00	372,874.90	
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	70,698.00	34,288.53		
SEGRO PLC	239,847.00	2,114,970.84		
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	361,237.00	541,133.02		
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	187,422.00	141,878.45		

	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	113,949.00	98,110.08	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	34,770.00	22,600.50	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	420,000.00	681,240.00	
	UNITE GROUP PLC/THE	80,812.00	768,522.12	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	76,400.00	92,444.00	
	WAREHOUSE REIT PLC	72,100.00	64,169.00	
	WORKSPACE GROUP PLC	20,210.00	129,546.10	
	イギリス・ポンド小計	5,051,615.00	10,156,945.51 (1,904,630,422)	
イスラエル・シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	110,000.00	192,390.00	
	REIT 1 LTD	36,017.00	522,246.50	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	36,242.00	263,189.40	
	イスラエル・シュケル小計	182,259.00	977,825.90 (37,336,131)	
韓国・ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	6,350.00	23,717,250.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	24,000.00	120,000,000.00	
	JR REIT XXVII	36,632.00	130,959,400.00	
	KORAMCO LIFE INFRA REIT	6,226.00	29,324,460.00	
	KORAMCO LIFE INFRA RE-RIGHTS	618.00	61,800.00	
	LOTTE REIT CO LTD	20,121.00	75,554,355.00	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	12,561.00	46,601,310.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	8,762.00	54,412,020.00	
	SK REITS CO LTD	27,115.00	146,963,300.00	
	韓国・ウォン小計	142,385.00	627,593,895.00 (67,027,028)	
ユーロ	AEDIFICA	9,212.00	584,501.40	
	ALTAREA	723.00	75,336.60	
	CARE PROPERTY INVEST	5,582.00	81,385.56	
	CARMILA	10,208.00	174,148.48	
	COFINIMMO	6,947.00	461,628.15	
	COVIVIO	8,887.00	477,231.90	
	CROMWELL REIT EUR	48,320.00	74,412.80	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	7,912.00	193,844.00	
	GECINA SA	9,405.00	985,644.00	
	HAMBORNER REIT AG	12,897.00	84,088.44	
	ICADE	5,968.00	136,189.76	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	7,889.00	19,564.72	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	52,295.00	315,338.85	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	62,588.00	54,451.56	
	KLEPIERRE	34,558.00	964,168.20	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	12,639.00	102,502.29	
	MERCIALYS	15,342.00	184,104.00	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	71,325.00	818,097.75	
	MONTEA NV	3,238.00	257,421.00	
	NSI NV	2,966.00	60,506.40	

	RETAIL ESTATES	2,065.00	138,355.00	
	SHURGARD SELF STORAGE LTD	5,756.00	240,313.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	18,737.00	1,409,771.88	
	VASTNED RETAIL NV	2,919.00	71,223.60	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	30,825.00	764,460.00	
	WERELDHAVE NV	6,708.00	98,607.60	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	5,846.00	202,563.90	
	ユーロ小計	461,757.00	9,029,860.84 (1,429,697,867)	
投資証券合計			39,464,774,666 (39,464,774,666)	
合 計			39,464,774,666 (39,464,774,666)	

(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	139銘柄	75.9%	78.5%
カナダ・ドル	投資証券	26銘柄	1.4%	1.4%
オーストラリア・ドル	投資証券	31銘柄	6.9%	7.1%
香港・ドル	投資証券	6銘柄	0.9%	0.9%
シンガポール・ドル	投資証券	22銘柄	2.9%	3.0%
ニュージーランド・ドル	投資証券	4銘柄	0.3%	0.3%
イギリス・ポンド	投資証券	35銘柄	4.7%	4.8%
イスラエル・シケル	投資証券	3銘柄	0.1%	0.1%
韓国・ウォン	投資証券	9銘柄	0.2%	0.2%
ユーロ	投資証券	27銘柄	3.5%	3.6%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

## 2【ファンドの現況】

### 【純資産額計算書】

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド

2024年9月30日現在

資産総額	3,249,970,722円
負債総額	1,565,785円
純資産総額（ - ）	3,248,404,937円
発行済口数	2,051,786,541口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	1.5832円 (15,832円)

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

### イ 名義書換

該当事項はありません。

### ロ 受益者名簿

作成しません。

### ハ 受益者に対する特典

ありません。

## ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等

### （イ）受益権の譲渡

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

### （ロ）受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

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

### ホ 受益権の再分割

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

### ヘ 償還金

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

ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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



## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### イ 資本金の額および株式数

	2024年9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。

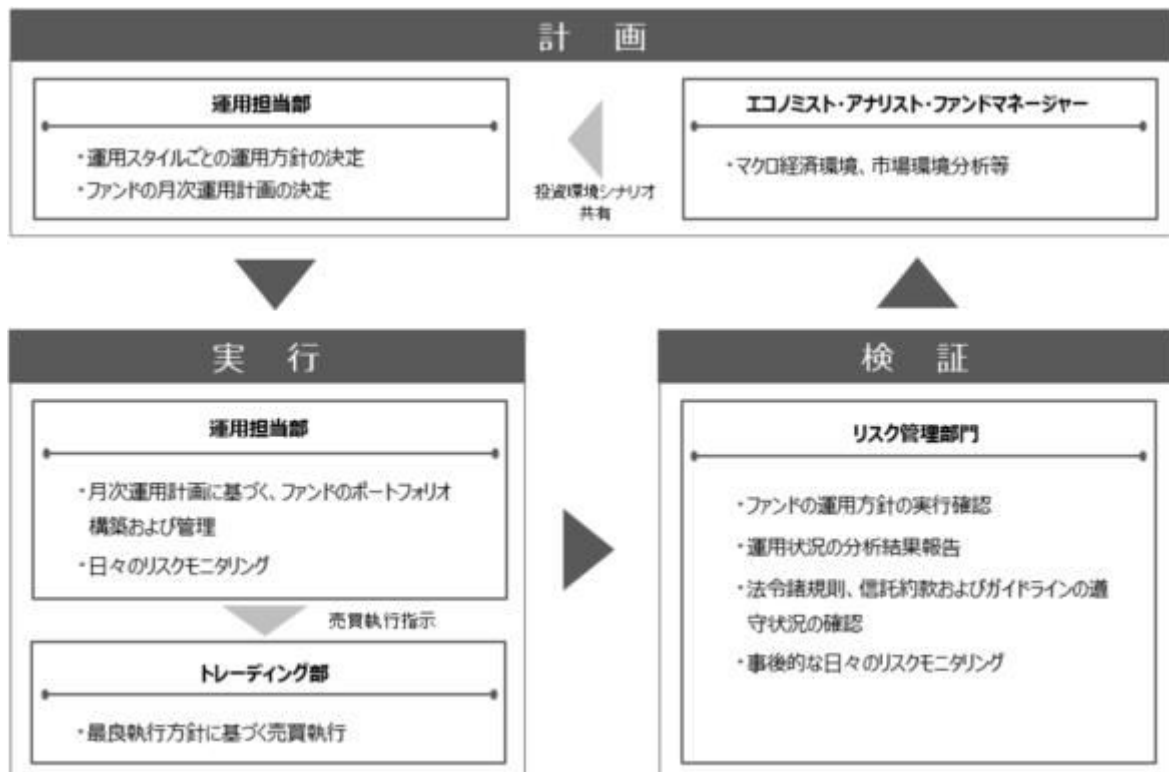
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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9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	656	12,573,982
単位型株式投資信託	85	656,370
追加型公社債投資信託	1	22,975
単位型公社債投資信託	146	233,812
合計	888	13,487,141

### 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)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
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
<b>流動資産合計</b>	<b>65,762,982</b>	<b>109,410,202</b>
<b>固定資産</b>		
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のれん	508,956	101,101
顧客関連資産	3,045,409	2,740,868
電話加入権	11,445,340	9,332,065
商標権	12,706	12,706
	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)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
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
<b>未払金</b>		
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
<b>未払費用</b>		
未払消費税等	6,370,986	7,405,559
未払法人税等	406,770	937,155
賞与引当金	333,009	5,104,541
資産除去債務	1,801,492	2,854,060
その他の流動負債	13,940	-
	73,657	17,443
流動負債合計	14,598,465	23,736,060
<b>固定負債</b>		
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
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	2,000,000	2,000,000
<b>資本剰余金</b>		
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		当事業年度	
	(自	2022年4月1日	(自	2023年4月1日
	至	2023年3月31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 hands 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	-
特別利益合計	-	14,096,622
特別損失		
固定資産除却損	2	13,203
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

子会社株式  
移動平均法による原価法

その他有価証券

市場価格のない株式等以外

決算日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

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。

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

## 4. 収益及び費用の計上基準

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

## (1) 委託者報酬

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

## (2) 運用受託報酬

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

## (3) 投資助言報酬

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

## (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、配当の効力発生日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、配当の効力発生日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、資金調達は行っていません。

### (2)金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

### (3)金融商品に係るリスク管理体制

#### 信用リスクの管理

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

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

#### 市場リスクの管理

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

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

また、特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、市場価格の変動リスクについて為替予約、株価指数先物、債券先物、スワップ取引などのデリバティブ取引により一部リスクヘッジしております。

## 2.金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（2023年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)金銭の信託	12,645,575	12,645,575	-
(2)投資有価証券 その他有価証券	9,182,466	9,182,466	-
資産計	21,828,042	21,828,042	-

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 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 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 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 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

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## (3)主要な顧客ごとの情報

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

## 3.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

## 4.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

## 5.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度（自 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

## 営業収益

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

## 有形固定資産

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

## (3)主要な顧客ごとの情報

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

## 3.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

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

## 4.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

## 5.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

## (関連当事者情報)

前事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

## 1.関連当事者との取引

## (1)兄弟会社等

(単位：千円)

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

## (注)取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

## 2.親会社に関する注記

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

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	(株)三井住友 銀行	東京都 千代田区	1,770,996,505	銀行業	-	% 投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	6,642,605	未払 手数料	1,630,250
親会社 の子会社	SMBC日興 証券(株)	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（2024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（2024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） 2024年3月末現在	事業の内容
PayPay銀行株式会社	72,216	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。
株式会社みなと銀行	39,984	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。
a u カブコム証券株式会社	7,196	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社SBI証券	54,323	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
岡三証券株式会社	5,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
Jトラストグローバル証券株式会社	3,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
静岡東海証券株式会社	600	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	19,495	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
フィリップ証券株式会社	950	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
S M B C 日興証券株式会社	135,000	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	13,195	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
播陽証券株式会社	112	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,945	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
岡三にいがた証券株式会社	852	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
住友生命保険相互会社	689,000	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、2023年12月末現在です。

楽天証券株式会社の資本金の額は、2023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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

2024年11月27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 和田 渉

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンドの2023年9月12日から2024年9月10日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンドの2024年9月10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、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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