

【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12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D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル1（保守型） 三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル2（安定型） 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） 三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル4（成長型） 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）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル1（保守型） 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル2（安定型） 2兆5,000億円を上限とします。 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） 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル4（成長型） 2兆5,000億円を上限とします。 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） 2兆5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）
 三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）
 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）
 三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）
 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）

以下、それぞれを「当ファンド」または「各ファンド」ということがあります。

また、「三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）」を「レベル1（保守型）」、「三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）」を「レベル2（安定型）」、「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）」を「レベル3（安定成長型）」、「三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）」を「レベル4（成長型）」、「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）」を「レベル5（積極成長型）」という略称でいうことがあります。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンド2兆5,000億円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「レベル1（保守型）」は「FW専用1」、「レベル2（安定型）」は「FW専用2」、「レベル3（安定成長型）」は「FW専用3」、「レベル4（成長型）」は「FW専用4」、「レベル5（積極成長型）」は「FW専用5」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	https://www.smd-am.co.jp
-----------------------	--------------	---

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

(5) 【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

(7) 【申込期間】

2024年12月13日から2025年6月12日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。

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

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

イ 申込証拠金

ありません。

ロ 日本以外の地域における募集

ありません。

八 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 取得申込みについて

当ファンドは、三井住友D Sアセットマネジメント株式会社が提供する投資一任運用サービス「MY GOALS（マイ ゴールズ）」の専用ファンドです。

ヘ 振替受益権について

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

（参考：投資信託振替制度）

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

イ 各ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式、不動産投資信託（リート）、商品等に分散投資することにより、それぞれ以下を目指して運用を行います。

ファンド	ファンドの目的
レベル1 (保守型)	信託財産の安定的な成長を目指して保守的な運用を行います。
レベル2 (安定型)	信託財産の安定的な成長を目指して運用を行います。
レベル3 (安定成長型)	信託財産の成長と安定的な収益の確保をバランスよく目指して運用を行います。
レベル4 (成長型)	信託財産の成長と安定的な収益の確保を目指して積極的な運用を行います。
レベル5 (積極成長型)	信託財産の成長を目指して積極的な運用を行います。

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

ハ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を含む)	ファミリーファンド	あり (部分ヘッジ)
	年2回	日本		
	年4回	北米		
債券 一般 公債 社債 その他債券	年6回(隔月)	欧州		
	年12回(毎月)	アジア		

クレジット属性 ()	日々	オセアニア		
不動産投信	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ファン ズ	なし
その他資産 (投資信託証券(資 産複合(株式、債 券、不動産投信、 商品)資産配分 変更型))		アフリカ		
資産複合 ()		中近東(中東)		
資産配分固定 型 資産配分変更 型		エマージング		

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

商品分類および属性区分は、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】

2023年3月24日 信託契約締結、設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(イ) 委託会社 「三井住友DSアセットマネジメント株式会社」

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

(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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

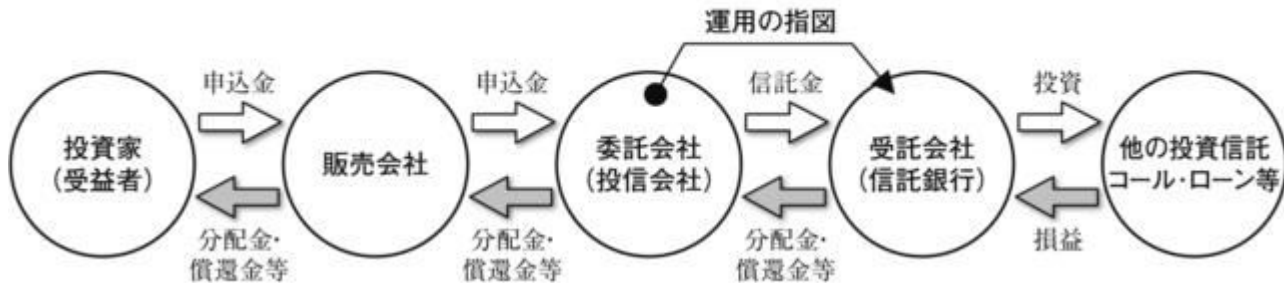
(ハ) 販売会社

委託会社との間で締結される販売契約(名称の如何を問いません。)に基づき、当ファンドの

募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

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。

運営の仕組み



□ 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

(ハ) 大株主の状況

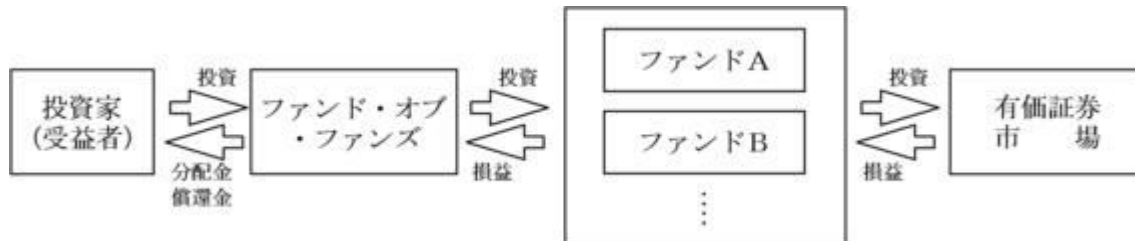
（2024年9月30日現在）

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

ハ ファンドの運用形態（ファンド・オブ・ファンズによる運用）

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

【ファンド・オブ・ファンズによる運用】



2【投資方針】

(1)【投資方針】

イ 基本方針

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式、不動産投資信託（リート）、商品等に分散投資することにより、信託財産の成長を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

(イ) 主として、投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式、不動産投資信託（リート）、商品等に分散投資することにより、各ファンド以下の運用を行います。

レベル1（保守型） 信託財産の安定的な成長を目指して保守的な運用を行います。

レベル2（安定型） 信託財産の安定的な成長を目指して運用を行います。

レベル3（安定成長型） 信託財産の成長と安定的な収益の確保をバランスよく目指して運用を行います。

レベル4（成長型） 信託財産の成長と安定的な収益の確保を目指して積極的な運用を行います。

レベル5（積極成長型） 信託財産の成長を目指して積極的な運用を行います。

(ロ) マクロ経済見通しおよび定量分析より推計した各資産の中長期的な期待収益率に基づいて、ファンドの期待リターンを設定し、最適な投資配分比率を決定します。

期待リターンは市場環境等に応じて見直しを行う場合があります。

(ハ) 実質外貨建資産に対して対円での為替ヘッジを行うことがあります。

(ニ) 投資対象とする投資信託証券は、投資対象資産、投資手法および費用等を考慮して選定します。また、継続的にモニタリングを行い必要な場合は見直しを行います。

(ホ) 投資信託証券への投資は、高位を保つことを原則とします。

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

ファンドの特色

1 各ファンドは、三井住友DSアセットマネジメント株式会社が提供する投資一任運用サービス「MY GOALS（マイ ゴールズ）」の専用ファンドです。

 MY GOALS(マイ ゴールズ)とは

三井住友DSアセットマネジメント株式会社がお客さまとの間で投資一任契約を締結し、アドバイザーである提携金融機関等を通じて、将来の目標(ゴール)を起点とする資産運用プランの策定ならびにゴールの実現に向けた継続的なアフターフォローを行うサービスです。

2 投資信託証券への投資を通じて、世界各国の債券、株式、不動産投資信託（リート）、商品等に分散投資します。

■投資対象とする投資信託証券は、投資対象資産、投資手法および費用等を考慮して選定します。また、継続的にモニタリングを行い必要な場合は見直しを行います。

3 マクロ経済見通しおよび定量分析より推計した各資産の中長期的な期待収益率に基づいて、各ファンドの期待リターン*を設定し、最適な資産配分比率を決定します。

*期待リターンは市場環境等に応じて見直しを行う場合があります。

 期待リターンとは

各ファンドが目標とするリターンの目安を示したものであり、一定の収益を得ることができる運用を意味するものではなく、またその達成を示唆あるいは保証するものではありません。

4 実質外貨建資産に対して対円での為替ヘッジを行うことがあります。

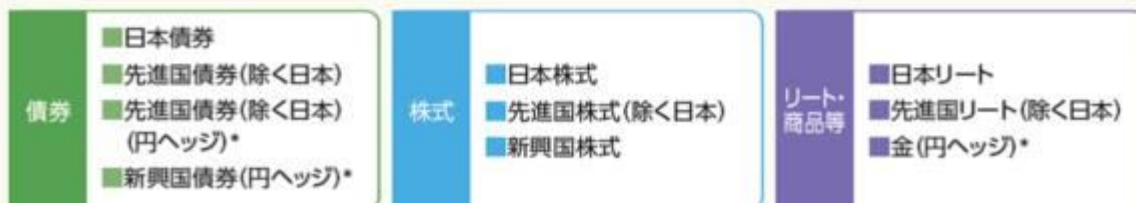
※資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

ファンドのしくみ

■ ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。



■ 投資対象資産の詳細は、以下の通りです。ただし、すべての資産に投資するとは限りません。



* 先進国債券(除く日本)(円ヘッジ)、新興国債券(円ヘッジ)および金(円ヘッジ)は、実質的に対円での為替ヘッジを行います。

※上記の投資対象資産は2024年9月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

運用プロセス

- 世界各国の債券、株式、不動産投資信託（リート）および商品等を投資対象とし、マクロ経済見通しおよび定量分析を用いた委託会社独自の手法により、資産配分比率を決定し、ポートフォリオを構築します。



※上記の運用プロセスは2024年9月末現在のものであり、今後変更される場合があります。

（参考情報）

▶投資一任運用サービス「MY GOALS(マイ ゴールズ)」について

- 「MY GOALS(マイ ゴールズ)」は、将来の目標(ゴール)を起点とする資産運用プランの策定ならびにゴールの実現に向けた継続的なアフターフォローを行う投資一任運用サービスです。
- お客さま(投資者)は、提携金融機関等(アドバイザー)を通じて、投資一任業者である三井住友DSアセットマネジメント株式会社と投資一任契約を締結していただけます。
 - 投資一任業者は提携金融機関等(アドバイザー)を通じて、資産運用プランの策定ならびにゴールの実現に向けた継続的なアフターフォローを行います。
 - 投資一任業者は、お客さま(投資者)に開設いただいた口座において、契約資産の運用を行います。



(2) 【投資対象】

イ 投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

- 1．有価証券
 - 2．約束手形（金融商品取引法第2条第1項第15号に掲げるものを除きます。）
 - 3．金銭債権
- (口) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産
- 1．為替手形
- 口 投資対象とする有価証券
- 委託会社は、信託金を、主として、投資信託証券および次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。
- 1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
 - 2．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券または証書の性質を有するもの
 - 3．外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 4．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人が発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）
- なお、第4号の証券にかかる運用の指図は買い現先取引（売戻条件付の買入れ）および債券貸借取引（現金担保付債券借入れ）に限り行うことができます。
- 八 投資対象とする金融商品
- 委託会社は、信託金を、上記口に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
- 1．預金
 - 2．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3．コール・ローン
 - 4．手形割引市場において売買される手形

〔参考情報：投資対象とする投資信託の概要〕

以下は、2024年9月末現在で知り得る情報に基づくものであり、今後、変更される場合があります。

- すべての投資信託に投資するとは限りません。

▶ 債券

日本債券

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
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ● NOMURA-BPI(総合)の動きに連動する投資成果を目指します。 ● 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。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.03%
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社

先進国債券（除く日本）

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

為替ヘッジ付き先進国債券（除く日本）

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

新興国債券

ファンド名	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ● JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指します。 ● 米ドル建ての新興国の公社債を主要投資対象とします。 ● 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.2%
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社

▶ 株式

日本株式

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

先進国株式(除く日本)

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

新興国株式

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

▶ リート・商品等

日本リート

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

先進国リート(除く日本)

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

金	
ファンド名	ゴールド・インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ● 金地金価格との連動を目指す投資信託証券*に投資し、LBMA金価格（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指します。 ● *投資対象とする投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い、商品性および運用上の効率性を損なわない範囲で、委託会社の判断により見直しを行うことがあります。 ● *投資対象とする投資信託証券は、以下の通りです。 [iShares Gold Trust] [SPDR Gold MiniShares Trust] ● ただし、一部の投資信託証券のみの投資となる場合があります。 ● 組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
信託財産留保額	ありません。
運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社

■ゴールド・インデックス・マザーファンドが投資対象とする投資信託証券の概要

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

- *1 管理費用とは各上場投資信託(以下「ETF」といいます。)の運用管理費用およびその他費用を各ETFの平均純資産総額で除したもので、本書の数値は各ETFの直近の目論見書等で開示されているものです。
- *2 外国籍のETFは、海外の上場有価証券を取り次ぐことのできる証券会社を通じて、日本国内の一般の投資者が、直接、購入することができるものがあります。直接購入される際は、売買委託手数料(証券会社ごとに異なります。)がかかります。また、円貨と外貨を交換する際に、証券会社が別途定める手数料がかかります。

- 投資対象とする投資信託においてデリバティブ取引を行う場合は、価格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。
- 投資対象とする投資信託において外国為替予約取引を行う場合は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

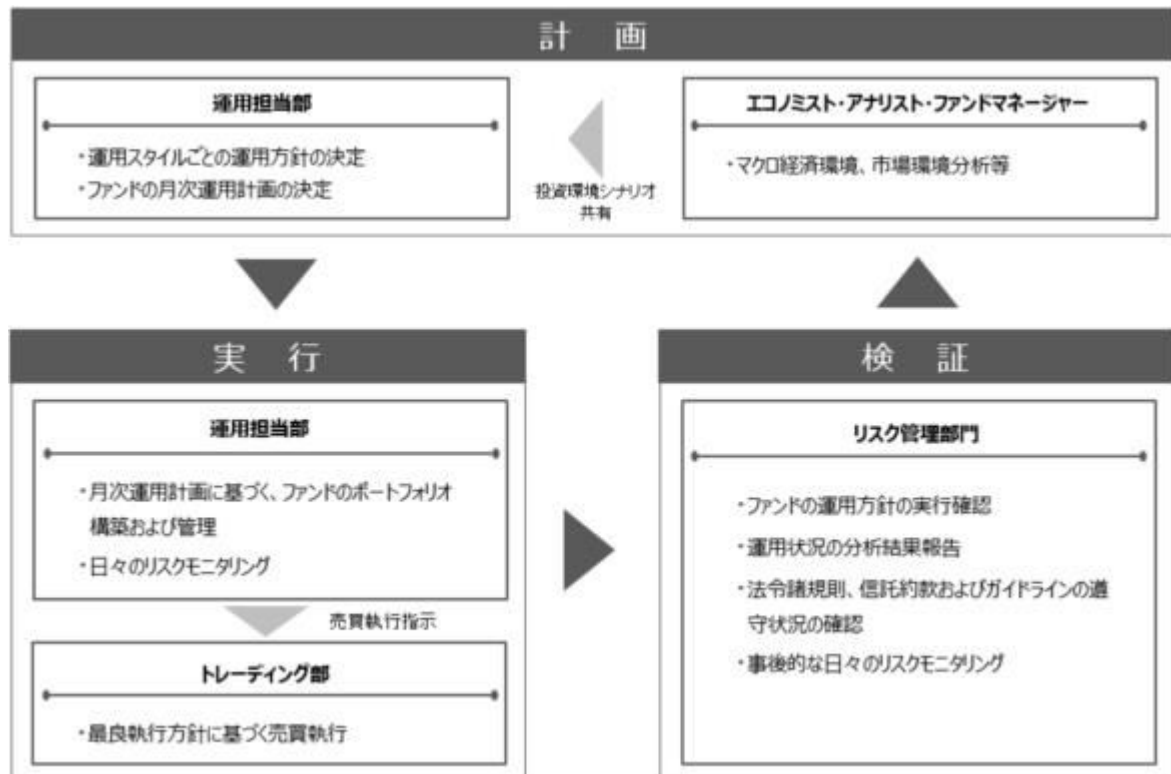
指数の著作権など

- 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、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスはJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシー、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 ダウ・ジョーンズ・インデックスLLC、LBMA金価格はICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッドが、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知的所有権その他一切の権利は、指数を公表する各社に帰属します。また、当該各社は各ファンドの運用に関して責任を負うものではありません。

※上記は、2024年9月末現在における投資対象とする投資信託であり、今後変更となる場合があります。

(3) 【運用体制】

イ ファンドの運用体制



リスク管理部門の人員数は、約40名です。

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

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

ロ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

(4) 【分配方針】

年1回（原則として毎年3月18日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、原則として以下の方針に基づき分配金額を決定します。

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

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

（基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。）

（５）【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく投資制限

イ 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

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

ハ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

ヘ 公社債の借入れの指図

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

（ロ）公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

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

（ニ）借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

ト 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。

チ 外国為替予約取引の指図

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

リ 資金の借入れ

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

（ロ）一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

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

（ニ）借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

法令に基づく投資制限

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

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

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

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

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

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

3【投資リスク】

イ ファンドのもつリスクの特性

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

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

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

当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

(イ) 株式市場リスク

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

(ロ) 債券市場リスク

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

(ハ) 不動産投資信託(リート)に関するリスク

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

(ニ) 商品(コモディティ)に関するリスク

商品市況は、多くの要因により変動します。要因の主なものとしては、対象となる商品の需給、貿易動向、天候、農業生産、商品産出地域の政治・経済情勢、疫病の発生などが挙げられます。商品市況の下落は、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

(ホ) 信用リスク

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

(ヘ) 為替変動リスク

ファンドは外貨建資産の一部について、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。

為替ヘッジを行う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。対円での為替ヘッジ比率は、資産配分の調整に伴い変動します。なお、円金利がヘッジ対象通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当分のヘッジコストがかかることにご留意ください。また、需給要因等によっては金利差相当分以上にヘッジコストがかかる場合があります。

(ト) カントリーリスク

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

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

(チ) 流動性リスク

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

□ その他の留意点

(イ) 投資信託に関する留意点

- ・当ファンドは一部、実質的に「ファミリーファンド方式」により運用します。そのため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・一部解約により資金の流出入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。

- ・ファンドのお申込みに関しては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

- ・ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

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

(ロ) 分配金に関する留意事項

分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの純資産から支払われますので、分配金が支

払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。



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

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

八 投資リスクの管理体制

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

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

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

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

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

（参考情報）投資リスクの定量的比較

「ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移」

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

■ レベル1（保守型）



「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。



■ レベル2（安定型）



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

「ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移」

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

■ レベル3（安定成長型）

年間騰落率：
2024年3月～2024年9月

分配金再投資基準価額：
2023年3月～2024年9月



「ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較」

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

ファンド：
2024年3月～2024年9月

他の資産クラス：
2019年10月～2024年9月



■ レベル4（成長型）

年間騰落率：
2024年3月～2024年9月

分配金再投資基準価額：
2023年3月～2024年9月



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

「ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移」

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

■ レベル5（積極成長型）



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

「ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較」

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



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

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

ただし、解約の際には、1口につき解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.1%の率を乗じて得

た信託財産留保額が差し引かれます。

(3) 【信託報酬等】

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

< 信託報酬率およびその配分、実質的な負担 >

ファンド名	信託報酬率	配分（税抜き）				投資対象とする 投資信託 ^{*1*2}	実質的な負担 ^{*2}	
		委託会社		提携金融機関等 (アドバイザー)	販売会社			受託会社
		運用報酬	投資一任報酬	投資一任報酬				
レベル1 (保守型)	年1.628% (税抜き1.48%)	年0.65%		年0.75%	年0.05%	年0.03%	年0.015% 程度	年1.643% (税抜き1.495%) 程度
	年0.05%	年0.60%						
レベル2 (安定型)	年1.738% (税抜き1.58%)	年0.75%		年0.75%	年0.05%	年0.03%	年0.0175% 程度	年1.7555% (税抜き1.5975%) 程度
	年0.15%	年0.60%						
レベル3 (安定成長型)	年1.793% (税抜き1.63%)	年0.80%		年0.75%	年0.05%	年0.03%	年0.02% 程度	年1.813% (税抜き1.65%) 程度
	年0.20%	年0.60%						
レベル4 (成長型)	年1.793% (税抜き1.63%)	年0.80%		年0.75%	年0.05%	年0.03%	年0.0225% 程度	年1.8155% (税抜き1.6525%) 程度
	年0.20%	年0.60%						
レベル5 (積極成長型)	年1.793% (税抜き1.63%)	年0.80%		年0.75%	年0.05%	年0.03%	年0.025% 程度	年1.818% (税抜き1.655%) 程度
	年0.20%	年0.60%						

* 1 各ファンドが投資対象とする投資信託では、信託報酬は収受されません。ただし、ゴールド・インデックス・マザーファンドが投資対象とする投資信託（以下、ETF）では、管理費用がかかります。

* 2 各ファンドにおいてゴールド・インデックス・マザーファンドを資産配分の上限比率で保有し、かつ管理費用が最大のETFを組み入れた場合の試算です（2024年9月末現在）。なお、管理費用は、今後変更される場合があります。実質的な負担は、資産配分比率の見直し、実際の組入状況および投資対象とする投資信託の変更等により変動します。

提携金融機関等への投資一任報酬は委託会社が拠出する資金に対しては支払われません。

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行った場合は、販売会社配分相当額も委託会社が収受します。

支払先	役務の内容	
委託会社	運用報酬	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
	投資一任報酬	投資一任契約に基づく契約資産の運用、契約資産の運用状況についての四半期毎の報告等の対価

提携金融機関等 (アドバイザー)	投資一任報酬	委託会社からの業務委託を受けた、投資一任契約の締結の媒介、資産運用プランの策定、ゴールの実現に向けた継続的なアフターフォロー等の対価
販売会社		交付運用報告書等各種書類の送付、投信口座および投資一任口座内のファンド管理等の対価
受託会社		ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

- イ 個別元本について
 - (イ) 追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等(申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。)が当該受益者の元本(個別元本)にあたります。
 - (ロ) 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合については、各販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本の算出が行われることがあります。
 - (ハ) 受益者が元本払戻金(特別分配金)を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。(「元本払戻金(特別分配金)」については、下記の(収益分配金の課税について)を参照。)
- ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

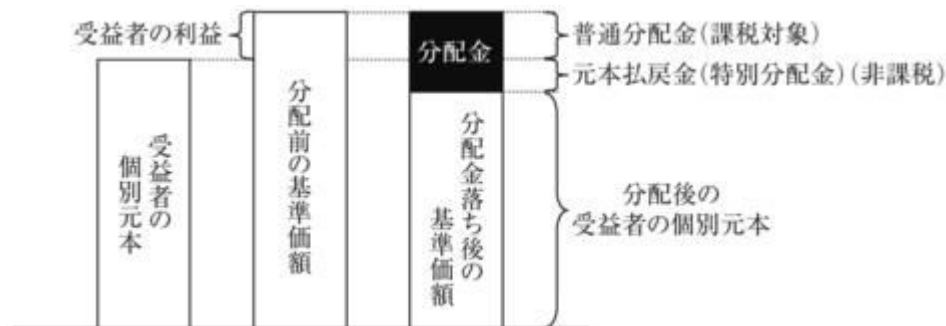
追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる

「元本払戻金(特別分配金)」(受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分)の区分がありません。

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。

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）」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3月24日～2024年3月18日）における当ファンドの総経費率（年率換算）は以下の通りです。

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

	総経費率(①+②)	①運用管理費用の比率	②その他費用の比率
レベル1(保守型)	1.79%	1.63%	0.16%
レベル2(安定型)	1.80%	1.74%	0.06%
レベル3(安定成長型)	1.84%	1.79%	0.05%
レベル4(成長型)	1.84%	1.79%	0.05%
レベル5(積極成長型)	1.85%	1.79%	0.06%

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

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

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

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

5【運用状況】

（1）【投資状況】

三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）

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	44,542,982	99.81
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	85,278	0.19
合計（純資産総額）		44,628,260	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。

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	売建	-	1,148,100	2.57

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）

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	618,125,121	99.69
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	1,905,118	0.31
合計（純資産総額）		620,030,239	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	売建	-	58,216,155	9.39

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3（安定成長型）

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	2,391,399,412	99.63
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	8,791,440	0.37
合計（純資産総額）		2,400,190,852	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	売建	-	314,375,786	13.10

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）

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	2,022,036,900	99.58
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	8,480,186	0.42
合計（純資産総額）		2,030,517,086	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	売建	-	325,831,177	16.05

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5（積極成長型）

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	664,760,170	99.50
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	3,319,241	0.50
合計(純資産総額)		668,079,411	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	売建	-	126,350,832	18.91

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)

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	ヘッジ付き外国 債券パッシブ・ マザーファンド	14,903,918	1.2162	18,126,352	1.2376	18,445,088	41.33
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	12,241,466	1.2044	14,743,341	1.1996	14,684,862	32.90
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)	875,783	4.8333	4,232,894	4.7669	4,174,769	9.35
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	1,120,762	2.2433	2,514,170	2.2578	2,530,456	5.67
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	175,874	8.7089	1,531,662	9.1343	1,606,485	3.60
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	415,601	2.5462	1,058,194	2.5759	1,070,546	2.40
日本	親投資 信託受 益証券	ゴールド・イン デックス・マ ザーファンド	447,328	1.6501	738,114	1.8298	818,520	1.83
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	298,679	2.0193	603,123	2.1820	651,717	1.46
日本	親投資 信託受 益証券	米ドル建て新興 国債インデック ス・マザーファ ンド	311,208	1.0834	337,173	1.0997	342,235	0.77

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	60,300	3.3111	199,657	3.6203	218,304	0.49
----	-------------------	------------------------------	--------	--------	---------	--------	---------	------

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	99.81
合計	99.81

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)

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	ヘッジ付き外国 債券パッシブ・ マザーファンド	141,714,355	1.2135	171,972,716	1.2376	175,385,685	28.29
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	117,834,547	1.1997	141,361,590	1.1996	141,354,322	22.80
日本	親投資 信託受 益証券	国内株式イン デックス・マ ザーファンド (B号)	24,192,794	4.8388	117,064,845	4.7669	115,324,629	18.60
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	18,719,566	2.5380	47,509,886	2.5759	48,219,730	7.78
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	5,197,848	8.9003	46,262,310	9.1343	47,478,702	7.66
日本	親投資 信託受 益証券	ゴールド・イン デックス・マ ザーファンド	21,016,266	1.6784	35,272,960	1.8298	38,455,563	6.20
日本	親投資 信託受 益証券	米ドル建て新興 国債インデック ス・マザーファ ンド	18,833,374	1.1023	20,759,469	1.0997	20,711,061	3.34
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	8,293,357	2.0704	17,170,530	2.1820	18,096,104	2.92
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	3,989,577	2.2771	9,084,544	2.2578	9,007,666	1.45
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	1,130,199	3.3275	3,760,716	3.6203	4,091,659	0.66

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	99.69
合計	99.69

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）

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	国内株式イン デックス・マ ザーファンド （B号）	120,587,631	4.7911	577,749,469	4.7669	574,829,178	23.95
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	382,388,848	1.2147	464,484,976	1.2376	473,244,438	19.72
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	314,123,832	1.2013	377,345,176	1.1996	376,822,948	15.70
日本	親投資 信託受 益証券	Jリート・イン デックス・マ ザーファンド	100,732,963	2.5375	255,610,433	2.5759	259,478,039	10.81
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	26,115,324	8.8510	231,146,762	9.1343	238,545,204	9.94
日本	親投資 信託受 益証券	ゴールド・イン デックス・マ ザーファンド	104,781,090	1.6626	174,205,005	1.8298	191,728,438	7.99
日本	親投資 信託受 益証券	米ドル建て新興 国債インデック ス・マザーファ ンド	111,814,366	1.0985	122,824,622	1.0997	122,962,258	5.12
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	40,034,369	2.0571	82,353,619	2.1820	87,354,993	3.64
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	19,499,852	2.2677	44,219,345	2.2578	44,026,765	1.83
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	6,189,308	3.3180	20,536,422	3.6203	22,407,151	0.93

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	99.63
合計	99.63

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)

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	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	125,449,367	4.8447	607,758,884	4.7669	598,004,587	29.45
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	106,018,344	2.5482	270,154,338	2.5759	273,092,652	13.45
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	27,593,843	9.0538	249,829,317	9.1343	252,050,440	12.41
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	187,045,474	1.2147	227,211,224	1.2376	231,487,478	11.40
日本	親投資信託受益証券	ゴールド・インデックス・マザーファンド	101,180,391	1.7116	173,181,917	1.8298	185,139,879	9.12
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	153,893,246	1.1968	184,183,863	1.1996	184,610,337	9.09
日本	親投資信託受益証券	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド	125,411,869	1.1152	139,861,515	1.0997	137,915,432	6.79
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	42,432,334	2.1090	89,489,008	2.1820	92,587,352	4.56
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	18,766,300	2.2981	43,127,374	2.2578	42,370,552	2.09
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	6,844,237	3.3773	23,114,773	3.6203	24,778,191	1.22

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別投資比率

2024年9月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.58
合計	99.58

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5（積極成長型）

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	国内株式イン デックス・マ ザーファンド (B号)	48,144,034	4.7997	231,078,123	4.7669	229,497,795	34.35
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	42,674,874	2.5440	108,564,836	2.5759	109,926,207	16.45
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	10,698,039	8.9350	95,586,925	9.1343	97,719,097	14.63
日本	親投資 信託受 益証券	ゴールド・イン デックス・マ ザーファンド	36,322,218	1.6911	61,422,831	1.8298	66,462,394	9.95
日本	親投資 信託受 益証券	米ドル建て新興 国債インデック ス・マザーファ ンド	53,821,543	1.1066	59,558,758	1.0997	59,187,550	8.86
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	16,557,102	2.0799	34,436,769	2.1820	36,127,596	5.41
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	17,514,431	1.2151	21,281,431	1.2376	21,675,859	3.24
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	14,156,707	1.1980	16,959,742	1.1996	16,982,385	2.54
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	7,514,433	2.2847	17,168,400	2.2578	16,966,086	2.54
日本	親投資 信託受 益証券	外国リート・イ ンデックス・マ ザーファンド	2,821,645	3.3481	9,447,167	3.6203	10,215,201	1.53

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別投資比率

2024年9月30日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	99.50
合計	99.50

【投資不動産物件】

三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル1 (保守型)

該当事項はありません。

三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル2 (安定型)

該当事項はありません。

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)

該当事項はありません。

三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル4 (成長型)

該当事項はありません。

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)

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル1 (保守型)

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	売建	8,068.00	1,151,139	1,148,100	2.57

(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。

三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル2 (安定型)

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	売建	409,100.00	58,317,648	58,216,155	9.39

(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。

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)

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	売建	2,209,200.00	315,030,420	314,375,786	13.10
------------	---------	----	--------------	-------------	-------------	-------

(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。

三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)

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	売建	2,289,700.00	326,536,982	325,831,177	16.05

(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。

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)

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	売建	887,900.00	126,672,803	126,350,832	18.91

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)

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 (2024年 3月18日)	24,404,041	24,404,041	10,414	10,414
2023年 9月末日	10,856,987	-	10,059	-
10月末日	15,616,275	-	9,922	-
11月末日	21,146,964	-	10,222	-
12月末日	21,375,760	-	10,333	-
2024年 1月末日	21,417,083	-	10,353	-
2月末日	26,501,894	-	10,396	-
3月末日	24,659,117	-	10,523	-
4月末日	31,401,143	-	10,417	-
5月末日	34,196,591	-	10,353	-
6月末日	34,527,446	-	10,453	-
7月末日	34,415,470	-	10,419	-
8月末日	34,500,329	-	10,445	-
9月末日	44,628,260	-	10,475	-

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）

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 (2024年 3月18日)	258,398,396	258,398,396	10,891	10,891
2023年 9月末日	121,986,554	-	10,348	-
10月末日	165,181,112	-	10,207	-
11月末日	196,165,289	-	10,563	-
12月末日	215,822,751	-	10,649	-
2024年 1月末日	243,342,142	-	10,751	-
2月末日	247,893,444	-	10,822	-
3月末日	289,971,805	-	11,072	-
4月末日	328,138,044	-	11,009	-
5月末日	380,339,272	-	10,961	-
6月末日	442,624,747	-	11,077	-
7月末日	544,580,317	-	11,033	-
8月末日	587,857,612	-	11,057	-
9月末日	620,030,239	-	11,093	-

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3（安定成長型）

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 (2024年 3月18日)	1,121,962,337	1,121,962,337	11,214	11,214
2023年 9月末日	422,681,812	-	10,547	-
10月末日	584,799,661	-	10,401	-
11月末日	695,728,200	-	10,796	-
12月末日	819,751,151	-	10,868	-
2024年 1月末日	922,292,743	-	11,027	-
2月末日	997,821,021	-	11,116	-
3月末日	1,173,833,607	-	11,446	-
4月末日	1,334,417,200	-	11,415	-
5月末日	1,447,528,344	-	11,386	-
6月末日	1,754,400,620	-	11,528	-
7月末日	2,009,950,095	-	11,457	-
8月末日	2,250,810,006	-	11,468	-
9月末日	2,400,190,852	-	11,502	-

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）

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 (2024年 3月18日)	668,185,314	668,185,314	11,512	11,512
2023年 9月末日	207,479,223	-	10,739	-
10月末日	232,341,427	-	10,578	-
11月末日	338,062,245	-	11,006	-
12月末日	368,916,446	-	11,066	-
2024年 1月末日	506,814,244	-	11,279	-
2月末日	587,454,863	-	11,388	-
3月末日	707,975,730	-	11,789	-
4月末日	769,864,044	-	11,784	-
5月末日	977,031,140	-	11,772	-
6月末日	1,190,692,242	-	11,942	-
7月末日	1,736,259,163	-	11,839	-
8月末日	1,913,557,918	-	11,825	-
9月末日	2,030,517,086	-	11,853	-

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)

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 (2024年 3月18日)	240,248,069	240,248,069	11,849	11,849
2023年 9月末日	80,671,477	-	10,947	-
10月末日	90,345,127	-	10,775	-
11月末日	128,298,154	-	11,242	-
12月末日	157,036,857	-	11,288	-
2024年 1月末日	205,090,228	-	11,561	-
2月末日	225,446,782	-	11,697	-
3月末日	249,833,406	-	12,171	-
4月末日	269,774,356	-	12,197	-
5月末日	345,663,192	-	12,208	-
6月末日	440,484,962	-	12,406	-
7月末日	539,023,246	-	12,272	-
8月末日	622,412,459	-	12,223	-
9月末日	668,079,411	-	12,244	-

【分配の推移】

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2023年 3月24日 ~ 2024年 3月18日	0

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2023年 3月24日 ~ 2024年 3月18日	0

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2023年 3月24日～2024年 3月18日	0

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2023年 3月24日～2024年 3月18日	0

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2023年 3月24日～2024年 3月18日	0

【収益率の推移】

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)

	収益率(%)
第1期	4.1
第2期(中間期)	0.3

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

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)

	収益率(%)
第1期	8.9
第2期(中間期)	0.8

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

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)

	収益率(%)
第1期	12.1
第2期(中間期)	1.1

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

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)

	収益率(%)
第1期	15.1

第2期(中間期)	1.1
----------	-----

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

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)

	収益率(%)
第1期	18.5
第2期(中間期)	1.1

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

(4)【設定及び解約の実績】

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	28,380,396	4,946,088
第2期(中間期)	19,170,466	0

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	240,675,062	3,412,475
第2期(中間期)	325,141,629	3,492,578

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	1,003,889,516	3,391,734
第2期(中間期)	1,045,977,135	23,225,366

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	583,651,620	3,247,608
第2期(中間期)	1,127,178,081	14,219,524

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	208,518,523	5,754,802
第2期(中間期)	332,624,030	436,642

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

（参考）

（１）投資状況

国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）

2024年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

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
-----------	-----------------	--------

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

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

米ドル建て新興国債インデックス・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（％）
国債証券	トルコ	1,026,839,156	10.19
	サウジアラビア	963,696,688	9.56
	メキシコ	832,958,863	8.27
	アラブ首長国連邦	756,100,328	7.50
	ブラジル	712,085,536	7.07
	チリ	638,578,301	6.34
	ポーランド	601,280,526	5.97
	コロンビア	565,343,538	5.61
	ドミニカ共和国	507,462,242	5.04
	ハンガリー	443,937,400	4.41
	カタール	430,959,104	4.28
	パナマ	372,916,951	3.70
	ペルー	367,127,965	3.64
	南アフリカ	295,514,043	2.93
	オマーン	272,945,433	2.71
	中国	250,761,480	2.49
	インドネシア	246,422,774	2.45

	ウルグアイ	159,486,644	1.58
	フィリピン	110,181,279	1.09
	小計	9,554,598,251	94.82
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	521,939,251	5.18
合計(純資産総額)		10,076,537,502	100.00

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
	ガーンジー	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
--------	----	---	-------------	------

ゴールド・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 (%)
投資信託受益証券	アメリカ	13,218,338,227	98.13
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	251,254,972	1.87
合計(純資産総額)		13,469,593,199	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	-	79,774,722	0.59

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

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(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	-	0.00
投資証券	-	2.02
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 ISLANDS	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	3.81
	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	-
	投資証券	-
	合計	92.67

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	3 6 2 1 0 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	3 6 6 1 0 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	3 6 8 1 0 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	3 6 1 1 0 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	3 6 3 1 0 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	3 6 5 1 0 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	3 7 1 1 0 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	3 6 7 1 0 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	3 5 9 1 0 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	3 6 4 1 0 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	1 4 9 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	3 7 2 1 0 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	3 5 7 1 0 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	3 7 3 1 0 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	3 7 4 1 0 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	3 5 8 1 0 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	1 4 7 2 0 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	1 5 8 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

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

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

米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

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 (%)
ポーランド	国債証券	REPUBLIC OF POLAND	2,100,000	14,285.27	299,990,770	14,701.90	308,739,976	5.125	2034/09/18	3.06
ドミニカ共和国	国債証券	DOMINICAN REPUBLIC	1,700,000	14,039.78	238,676,246	14,630.54	248,719,157	6.000	2033/02/22	2.47
トルコ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	1,400,000	16,238.82	227,343,484	16,728.67	234,201,375	9.375	2033/01/19	2.32
トルコ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	1,400,000	15,821.91	221,506,683	16,194.57	226,724,035	9.875	2028/01/15	2.25
コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	1,400,000	14,487.95	202,831,319	14,852.91	207,940,767	7.500	2034/02/02	2.06

ポーランド	国債証券	REPUBLIC OF POLAND	1,400,000	14,058.29	196,816,106	14,627.54	204,785,578	5.500	2054/03/18	2.03
パナマ	国債証券	REPUBLIC OF PANAMA	1,400,000	13,797.99	193,171,923	14,612.70	204,577,763	6.400	2035/02/14	2.03
ブラジル	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,400,000	14,008.95	196,125,293	14,479.39	202,711,426	6.000	2033/10/20	2.01
サウジアラビア	国債証券	SAUDI INTERNATIONAL BOND	1,600,000	11,514.89	184,238,167	11,955.92	191,294,738	2.250	2033/02/02	1.90
ドミニカ共和国	国債証券	DOMINICAN REPUBLIC	1,400,000	12,264.36	171,701,049	13,339.55	186,753,641	5.875	2060/01/30	1.85
南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,300,000	13,178.40	171,319,247	14,192.64	184,504,359	7.300	2052/04/20	1.83
オマーン	国債証券	OMAN GOV INTERNTL BOND	1,200,000	14,913.43	178,961,154	15,256.84	183,082,054	6.250	2031/01/25	1.82
トルコ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	1,100,000	15,822.62	174,048,815	16,306.90	179,375,927	9.125	2030/07/13	1.78
カタール	国債証券	STATE OF QATAR	1,300,000	12,861.26	167,196,348	13,292.30	172,799,928	4.400	2050/04/16	1.71
サウジアラビア	国債証券	SAUDI INTERNATIONAL BOND	1,100,000	14,152.43	155,676,752	14,673.79	161,411,644	5.750	2054/01/16	1.60
アラブ首長国連邦	国債証券	ABU DHABI GOVT INT'L	1,300,000	11,959.06	155,467,796	12,379.26	160,930,358	1.875	2031/09/15	1.60
ハンガリー	国債証券	HUNGARY	1,100,000	13,955.28	153,508,113	14,389.04	158,279,434	5.500	2036/03/26	1.57
メキシコ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,200,000	11,973.48	143,681,723	12,312.60	147,751,241	2.659	2031/05/24	1.47
サウジアラビア	国債証券	SAUDI INTERNATIONAL BOND	1,000,000	14,202.92	142,029,195	14,628.83	146,288,258	5.000	2034/01/16	1.45
チリ	国債証券	REPUBLIC OF CHILE	1,100,000	12,681.24	139,493,597	13,127.73	144,405,079	3.500	2034/01/31	1.43
カタール	国債証券	STATE OF QATAR	1,000,000	13,721.63	137,216,340	14,134.55	141,345,519	3.750	2030/04/16	1.40
ハンガリー	国債証券	HUNGARY	900,000	14,925.28	134,327,484	15,399.57	138,596,111	6.250	2032/09/22	1.38
メキシコ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,000,000	13,398.64	133,986,360	13,748.47	137,484,672	4.875	2033/05/19	1.36

アラブ首長国連邦	国債証券	ABU DHABI GOVT INT'L	1,300,000	9,971.55	129,630,097	10,533.19	136,931,451	3.125	2049/09/30	1.36
メキシコ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	900,000	13,640.71	122,766,354	14,288.99	128,600,871	6.338	2053/05/04	1.28
ペルー	国債証券	REPUBLIC OF PERU	1,000,000	12,365.13	123,651,280	12,763.49	127,634,875	2.783	2031/01/23	1.27
コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	800,000	14,966.38	119,731,058	15,341.48	122,731,814	8.000	2033/04/20	1.22
ペルー	国債証券	REPUBLIC OF PERU	800,000	14,138.69	113,109,528	14,740.16	117,921,242	5.625	2050/11/18	1.17
メキシコ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	800,000	14,189.93	113,519,449	14,630.68	117,045,451	6.000	2036/05/07	1.16
トルコ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	800,000	14,131.13	113,049,011	14,598.00	116,783,969	6.125	2028/10/24	1.16

□ 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	94.82
合計	94.82

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	G L P 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	K D X 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

ゴールド・インデックス・マザーファンド

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 (%)
アメリカ	投資信託受益証券	SPDR GOLD MINISHARES TRUST	1,161,760	6,835.4199	7,941,117,481	7,501.8888	8,715,394,332	64.70
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES GOLD TRUST	629,840	6,492.7877	4,089,417,404	7,149.3457	4,502,943,895	33.43

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（％）
投資信託受益証券	98.13
合計	98.13

投資不動産物件

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)
該当事項はありません。

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。

国内債券パッシブ・マザーファンド
該当事項はありません。

外国債券パッシブ・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。

米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド
該当事項はありません。

Jリート・インデックス・マザーファンド
該当事項はありません。

外国リート・インデックス・マザーファンド
該当事項はありません。

ゴールド・インデックス・マザーファンド
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

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	TOPI X 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-EU	FTSE 100 INDEX DEC 24 2024年12月	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	EUROXX	EURO STOXX 50 DEC 24 2024年12月	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 EMIN INDEX DEC 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	SPI 200 FUTURES 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	I C E - U S	M S C I E M G M K T D E C 2 4 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。

国内債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・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。

米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

Jリート・インデックス・マザーファンド

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。

ゴールド・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	559,000.00	79,758,231	79,774,722	0.59

(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

■ レベル1 (保守型)



分配の推移

決算期	分配金
2024年3月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万円当たり、税引前です。

■ レベル2 (安定型)



決算期	分配金
2024年3月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万円当たり、税引前です。

■ レベル3 (安定成長型)



決算期	分配金
2024年3月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万円当たり、税引前です。

※基準価額は、1万円当たり、信託報酬控除後です。

■ レベル4 (成長型)



決算期	分配金
2024年3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。

■ レベル5 (積極成長型)



決算期	分配金
2024年3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。

※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

主要な資産の状況

■ レベル1 (保守型)

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	99.81
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.19
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	41.33
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	32.90
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)	9.35
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	5.67
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	3.60
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	2.40
日本	親投資信託受益証券	ゴールド・インデックス・マザーファンド	1.83
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	1.46
日本	親投資信託受益証券	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド	0.77
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	0.49

■ レベル2 (安定型)

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	99.69
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.31
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	28.29
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	22.80
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)	18.60
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	7.78
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	7.66
日本	親投資信託受益証券	ゴールド・インデックス・マザーファンド	6.20
日本	親投資信託受益証券	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド	3.34
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	2.92
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	1.45
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	0.66

*比率は、ファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

■ レベル3（安定成長型）

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	99.63
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.37
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	23.95
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	19.72
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	15.70
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	10.81
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	9.94
日本	親投資信託受益証券	ゴールド・インデックス・マザーファンド	7.99
日本	親投資信託受益証券	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド	5.12
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	3.64
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	1.83
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	0.93

■ レベル4（成長型）

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	99.58
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.42
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	29.45
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	13.45
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	12.41
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	11.40
日本	親投資信託受益証券	ゴールド・インデックス・マザーファンド	9.12
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	9.09
日本	親投資信託受益証券	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド	6.79
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	4.56
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	2.09
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	1.22

※比率は、ファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

■ レベル5（積極成長型）

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	99.50
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.50
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(8号)	34.35
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	16.45
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	14.63
日本	親投資信託受益証券	ゴールド・インデックス・マザーファンド	9.95
日本	親投資信託受益証券	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド	8.86
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	5.41
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	3.24
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	2.54
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	2.54
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	1.53

※比率は、ファンドの純資産総額に対する時価の比率です。

▶ 投資対象とする投資信託の現況

■ 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

■ 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。

■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

■米ドル建て新興国債インデックス・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	利率(%)	償還期限	比率(%)
ポーランド	国債証券	REPUBLIC OF POLAND	5.125	2034/09/18	3.06
ドミニカ共和国	国債証券	DOMINICAN REPUBLIC	6.000	2033/02/22	2.47
トルコ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	9.375	2033/01/19	2.32
トルコ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	9.875	2028/01/15	2.25
コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	7.500	2034/02/02	2.06

■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。

■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

■ゴールド・インデックス・マザーファンド

主要投資銘柄(上位5銘柄)

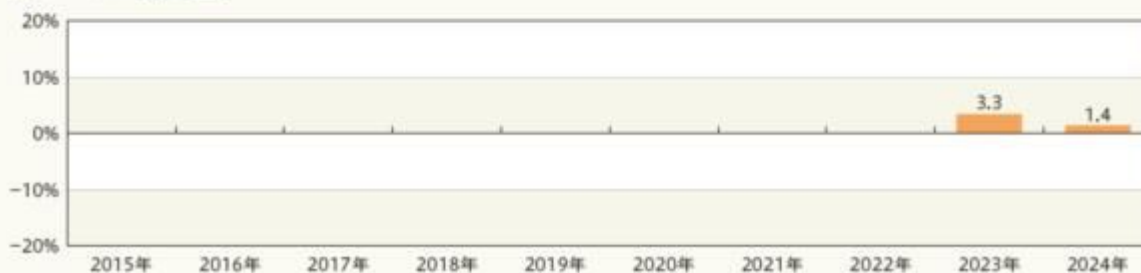
国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
アメリカ	投資信託受益証券	SPDR GOLD MINISHARES TRUST	64.70
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES GOLD TRUST	33.43

※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。

※「主要投資銘柄(上位5銘柄)」は組入有価証券が5銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

年間収益率の推移(暦年ベース)

■レベル1(保守型)



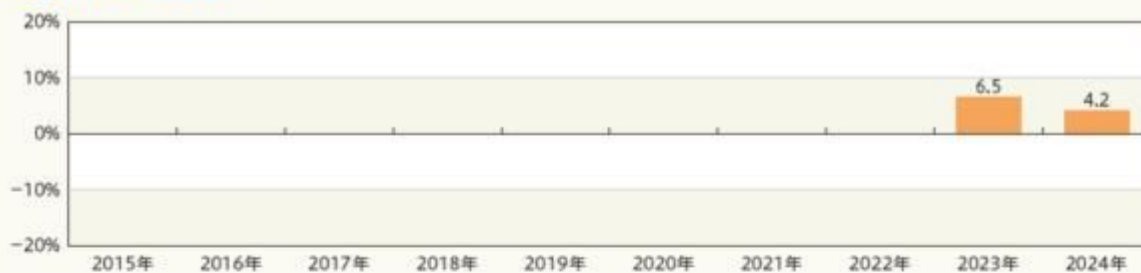
※収益率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しています。分配実績がない場合は、基準価額の騰落率です。

※ファンドが設定された年の収益率は、設定日から年末までの騰落率です。

※2024年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。

※ファンドにはベンチマークはありません。

■ レベル2（安定型）



■ レベル3（安定成長型）



■ レベル4（成長型）



■ レベル5（積極成長型）



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

※ファンドが設定された年の収益率は、設定日から年末までの騰落率です。

※2024年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。

※ファンドにはベンチマークはありません。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

イ 申込方法

（イ）当ファンドは、三井住友D S アセットマネジメント株式会社が提供する投資一任運用サービス「MY GOALS（マイ ゴールズ）」の専用ファンドです。

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、取得申込みの受付を中止させていただく場合、既に受け付けた取得申込みを取り消させていただきます場合があります。

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

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

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

(二) 申込不可日

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

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

ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

ハ 申込手数料

ありません。

ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社にお問い合わせください。

ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

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

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

2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

ただし、以下のいずれかに当たる場合には、解約請求の受付は行いません。

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

解約請求のお申込みに関しては、原則として午後3時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

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を差し引いた価額となります。

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

イ 基準価額の算出方法

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

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

< マザーファンドの主要投資対象の評価方法 >

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

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

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、「レベル1(保守型)」は「FW専用1」、「レベル2(安定型)」は「FW専用2」、「レベル3(安定成長型)」は「FW専用3」、「レベル4(成長型)」は「FW専用4」、「レベル5(積極成長型)」は「FW専用5」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	https://www.smd-am.co.jp

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

(2)【保管】

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

(3)【信託期間】

2023年3月24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3月19日から翌年3月18日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

イ 信託の終了

(イ) 信託契約の解約

- a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、各ファンドにつき残存口数が30億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記aの事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

- e. 上記b～dまでの取扱いは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b～dまでの取扱いを行うことが困難な場合も同様とします。
- (ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令
委託会社は、監督官庁より当ファンドの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い信託契約を解約し、信託を終了させます。
- (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。委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- b. 分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として決算日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として)に支払われます。
- ただし、分配金自動再投資コースにかかる収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づいて、毎計算期間終了日の翌営業日に無手数料で再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。
- (ロ) 償還金
償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として償還日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として)に支払われます。
- 八 信託約款の変更等
- (イ) 委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする

旨および内容を監督官庁に届け出ます。

- (ロ) 委託会社は、上記(イ)の事項（変更についてはその内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知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。
- (ハ) 上記(ロ)の書面決議において、受益者（委託会社等を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- (ニ) 書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います（書面決議は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。）。
- (ホ) 上記(ロ)から(ニ)までの取扱いは、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- (ヘ) 上記にかかわらず、当ファンドと他のファンドとの併合の場合は、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、相手方となる他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、併合を行うことはできません。

二 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

ホ 販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問わず、ファンドの募集・販売の取扱い、受益者からの一部解約実行請求の受付、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でも、何らの意思表示もない場合は、自動的に1年間更新されます。販売契約の内容は、必要に応じて、委託会社と販売会社との合意により変更されることがあります。

ヘ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

ト 公告

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

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

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

チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

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

4 【受益者の権利等】

委託会社の指図に基づく行為によりファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属しま

す。当ファンドの受益権は、信託の日時を異にすることにより差異が生ずることはありません。

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ 分配金請求権

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

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

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

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

ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

ハ 一部解約実行請求権

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

ニ 書面決議における議決権

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

ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期(2023年3月24日から2024年3月18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D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）】

（ 1 ）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 (2024年 3月18日現在)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	9,807
コール・ローン	365,866
親投資信託受益証券	24,189,965
未収入金	6,608
流動資産合計	24,572,246
資産合計	24,572,246
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	13,648
未払受託者報酬	3,092
未払委託者報酬	151,073
その他未払費用	392
流動負債合計	168,205
負債合計	168,205
純資産の部	
元本等	
元本	23,434,308
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	969,733
（分配準備積立金）	448,497
元本等合計	24,404,041
純資産合計	24,404,041
負債純資産合計	24,572,246

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期 自 2023年 3月24日 至 2024年 3月18日
営業収益	
有価証券売買等損益	796,665
為替差損益	42,667
営業収益合計	753,998
営業費用	
受託者報酬	3,734
委託者報酬	184,303
その他費用	14,032
営業費用合計	202,069
営業利益又は営業損失 ()	551,929
経常利益又は経常損失 ()	551,929
当期純利益又は当期純損失 ()	551,929
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 ()	103,432
期首剰余金又は期首欠損金 ()	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	619,604
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	619,604
剰余金減少額又は欠損金増加額	98,368
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	98,368
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 ()	969,733

（ 3 ）【注記表】

（重要な会計方針の注記）

項 目	第1期	
	自 2023年3月24日 至 2024年3月18日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>	

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項 目	第1期	
	（2024年3月18日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	23,434,308口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0414円 （1万口当たりの純資産額10,414円）	

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項 目	第1期	
	自 2023年3月24日 至 2024年3月18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（158,053円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（290,444円）、収益調整金（521,236円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は969,733円（1万口当たり413.81円）であります。分配を行っておりません。</p>	

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自 2023年3月24日 至 2024年3月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、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1期 (2024年3月18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1期（自 2023年3月24日 至 2024年3月18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	599,128円
合計	599,128円

(デリバティブ取引に関する注記)

第1期(2024年3月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち 1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	824,089	-	837,737	13,648
	小計	824,089	-	837,737	13,648
合 計		824,089	-	837,737	13,648

(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)

第1期 自 2023年3月24日 至 2024年3月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項 目	第1期 (2024年3月18日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	27,380,396円

期中一部解約元本額	4,946,088円
-----------	------------

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド	212,232	227,173	
	ゴールド・インデックス・マザーファンド	361,870	565,638	
	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	569,202	2,733,023	
	外国株式インデックス・マザーファンド	140,744	1,199,659	
	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	6,689,979	8,136,352	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	679,469	1,512,701	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	7,183,699	8,698,741	
	Jリート・インデックス・マザーファンド	289,016	723,898	
	外国リート・インデックス・マザーファンド	30,988	99,657	
	エマージング株式インデックス・マザーファンド	148,643	293,123	
	親投資信託受益証券 小計			24,189,965
合 計			24,189,965	

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。

【三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）】

（ 1 ）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 (2024年 3月18日現在)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	76,774
コール・ローン	2,864,331
親投資信託受益証券	257,524,737
未収入金	110,020
流動資産合計	260,575,862
資産合計	260,575,862
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	468,881
未払受託者報酬	32,298
未払委託者報酬	1,670,972
その他未払費用	5,315
流動負債合計	2,177,466
負債合計	2,177,466
純資産の部	
元本等	
元本	237,262,587
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	21,135,809
（分配準備積立金）	9,967,661
元本等合計	258,398,396
純資産合計	258,398,396
負債純資産合計	260,575,862

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期 自 2023年 3月24日 至 2024年 3月18日
営業収益	
有価証券売買等損益	12,962,067
為替差損益	1,030,797
営業収益合計	11,931,270
営業費用	
支払利息	16
受託者報酬	36,265
委託者報酬	1,877,397
その他費用	18,955
営業費用合計	1,932,633
営業利益又は営業損失 ()	9,998,637
経常利益又は経常損失 ()	9,998,637
当期純利益又は当期純損失 ()	9,998,637
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 ()	30,976
期首剰余金又は期首欠損金 ()	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	11,324,943
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	11,324,943
剰余金減少額又は欠損金増加額	156,795
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	156,795
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 ()	21,135,809

(3)【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第1期
	自 2023年3月24日 至 2024年3月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	第1期
	(2024年3月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	237,262,587口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0891円 (1万口当たりの純資産額10,891円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期
	自 2023年3月24日 至 2024年3月18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(1,962,235円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(8,005,426円)、収益調整金(11,168,148円)、および分配準備積立金(0円)より、分配対象収益は21,135,809円(1万口当たり890.82円)ですが、分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自 2023年3月24日 至 2024年3月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、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1期 (2024年3月18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1期（自 2023年3月24日 至 2024年3月18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	12,862,611円
合計	12,862,611円

(デリバティブ取引に関する注記)

第1期(2024年3月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	27,213,158	-	27,682,039	468,881
	小計	27,213,158	-	27,682,039	468,881
合 計		27,213,158	-	27,682,039	468,881

(注)1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第1期 自 2023年3月24日 至 2024年3月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項 目	第1期 (2024年3月18日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	239,675,062円

期中一部解約元本額	3,412,475円
-----------	------------

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益 証券	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド	8,898,036	9,524,457	
	ゴールド・インデックス・マザーファンド	10,623,315	16,605,303	
	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	9,287,154	44,592,269	
	外国株式インデックス・マザーファンド	2,481,010	21,147,384	
	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	47,451,604	57,710,640	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	8,896,240	19,805,699	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	48,227,383	58,398,538	
	Jリート・インデックス・マザーファンド	9,178,425	22,989,201	
	外国リート・インデックス・マザーファンド	538,158	1,730,716	
	エマージング株式インデックス・マザーファンド	2,545,908	5,020,530	
	親投資信託受益証券 小計			257,524,737
合 計			257,524,737	

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。

【三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル3（安定成長型）】

（ 1 ）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 (2024年 3月18日現在)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	224,319
コール・ローン	8,369,005
親投資信託受益証券	1,121,914,475
未収入金	796,745
流動資産合計	1,131,304,544
資産合計	1,131,304,544
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,758,846
未払受託者報酬	120,749
未払委託者報酬	6,442,177
その他未払費用	20,435
流動負債合計	9,342,207
負債合計	9,342,207
純資産の部	
元本等	
元本	1,000,497,782
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	121,464,555
（分配準備積立金）	46,586,791
元本等合計	1,121,962,337
純資産合計	1,121,962,337
負債純資産合計	1,131,304,544

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期 自 2023年 3月24日 至 2024年 3月18日
営業収益	
受取利息	3
有価証券売買等損益	59,970,255
為替差損益	5,847,390
営業収益合計	54,122,868
営業費用	
支払利息	292
受託者報酬	137,232
委託者報酬	7,323,198
その他費用	34,077
営業費用合計	7,494,799
営業利益又は営業損失 ()	46,628,069
経常利益又は経常損失 ()	46,628,069
当期純利益又は当期純損失 ()	46,628,069
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 ()	41,278
期首剰余金又は期首欠損金 ()	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	75,105,030
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	75,105,030
剰余金減少額又は欠損金増加額	227,266
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	227,266
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 ()	121,464,555

（ 3 ）【注記表】

（重要な会計方針の注記）

項 目	第1期	
	自 2023年3月24日 至 2024年3月18日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>	

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項 目	第1期	
	（2024年3月18日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,000,497,782口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1214円 （1万口当たりの純資産額11,214円）	

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項 目	第1期	
	自 2023年3月24日 至 2024年3月18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（8,182,675円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（38,404,116円）、収益調整金（74,877,764円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は121,464,555円（1万口当たり1,214.04円）であります。分配を行っておりません。</p>	

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自 2023年3月24日 至 2024年3月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、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1期 (2024年3月18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った場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第1期（自 2023年3月24日 至 2024年3月18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	60,006,908円
合計	60,006,908円

（デリバティブ取引に関する注記）

第1期（2024年3月18日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	153,457,559	-	156,216,405	2,758,846
	小計	153,457,559	-	156,216,405	2,758,846
合 計		153,457,559	-	156,216,405	2,758,846

（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）

第1期 自 2023年3月24日 至 2024年3月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

項 目	第1期 (2024年3月18日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	1,002,889,516円

期中一部解約元本額	3,391,734円
-----------	------------

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益 証券	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド	61,456,512	65,783,050	
	ゴールド・インデックス・マザーファンド	57,304,223	89,572,230	
	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	50,158,175	240,834,477	
	外国株式インデックス・マザーファンド	13,468,456	114,801,078	
	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	141,267,544	171,809,587	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	37,964,348	84,520,027	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	142,958,651	173,108,630	
	Jリート・インデックス・マザーファンド	57,487,834	143,989,777	
	外国リート・インデックス・マザーファンド	3,352,612	10,782,000	
	エマージング株式インデックス・マザーファンド	13,546,460	26,713,619	
	親投資信託受益証券 小計			1,121,914,475
合 計			1,121,914,475	

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。

【三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）】

（ 1 ）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 (2024年 3月18日現在)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	170,958
コール・ローン	6,378,187
親投資信託受益証券	666,221,024
未収入金	667,989
流動資産合計	673,438,158
資産合計	673,438,158
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,957,970
未払受託者報酬	60,421
未払委託者報酬	3,224,428
その他未払費用	10,025
流動負債合計	5,252,844
負債合計	5,252,844
純資産の部	
元本等	
元本	580,404,012
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	87,781,302
（分配準備積立金）	27,762,621
元本等合計	668,185,314
純資産合計	668,185,314
負債純資産合計	673,438,158

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第1期 自 2023年 3月24日 至 2024年 3月18日
営業収益	
受取利息	2
有価証券売買等損益	34,735,914
為替差損益	3,296,831
営業収益合計	31,439,085
営業費用	
支払利息	155
受託者報酬	67,744
委託者報酬	3,616,610
その他費用	23,665
営業費用合計	3,708,174
営業利益又は営業損失 ()	27,730,911
経常利益又は経常損失 ()	27,730,911
当期純利益又は当期純損失 ()	27,730,911
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 ()	31,710
期首剰余金又は期首欠損金 ()	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	60,288,402
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	60,288,402
剰余金減少額又は欠損金増加額	269,721
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	269,721
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 ()	87,781,302

（ 3 ）【注記表】

（重要な会計方針の注記）

項 目	第1期	
	自 2023年3月24日 至 2024年3月18日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>	

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項 目	第1期	
	（2024年3月18日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	580,404,012口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1512円 （1万口当たりの純資産額11,512円）	

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項 目	第1期	
	自 2023年3月24日 至 2024年3月18日	
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（4,512,974円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（23,249,647円）、収益調整金（60,018,681円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は87,781,302円（1万口当たり1,512.42円）であります、分配を行っておりません。</p>	

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自 2023年3月24日 至 2024年3月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、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1期 (2024年3月18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1期（自 2023年3月24日 至 2024年3月18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	34,842,390円
合計	34,842,390円

(デリバティブ取引に関する注記)

第1期(2024年3月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	112,230,444	-	114,188,414	1,957,970
	小計	112,230,444	-	114,188,414	1,957,970
合 計		112,230,444	-	114,188,414	1,957,970

(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)

第1期 自 2023年3月24日 至 2024年3月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項 目	第1期 (2024年3月18日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	582,651,620円

期中一部解約元本額	3,247,608円
-----------	------------

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益 証券	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド	49,351,400	52,825,738	
	ゴールド・インデックス・マザーファンド	38,284,575	59,842,619	
	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	35,298,782	169,487,101	
	外国株式インデックス・マザーファンド	9,441,829	80,479,317	
	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	48,832,543	59,390,138	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	21,297,579	47,414,800	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	49,413,167	59,834,403	
	Jリート・インデックス・マザーファンド	44,153,004	110,590,029	
	外国リート・インデックス・マザーファンド	2,349,121	7,554,773	
	エマージング株式インデックス・マザーファンド	9,534,537	18,802,106	
	親投資信託受益証券 小計			666,221,024
合 計			666,221,024	

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。

【三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル5（積極成長型）】

（ 1 ）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 (2024年 3月18日現在)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	103,395
コール・ローン	3,857,508
親投資信託受益証券	238,174,768
未収入金	270,237
流動資産合計	242,405,908
資産合計	242,405,908
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	867,288
未払受託者報酬	23,649
未払委託者報酬	1,262,823
その他未払費用	4,079
流動負債合計	2,157,839
負債合計	2,157,839
純資産の部	
元本等	
元本	202,763,721
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	37,484,348
（分配準備積立金）	12,572,126
元本等合計	240,248,069
純資産合計	240,248,069
負債純資産合計	242,405,908

（ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第1期 自 2023年 3月24日 至 2024年 3月18日
営業収益	
有価証券売買等損益	16,307,118
為替差損益	1,924,290
営業収益合計	14,382,828
営業費用	
支払利息	24
受託者報酬	28,169
委託者報酬	1,505,797
その他費用	17,719
営業費用合計	1,551,709
営業利益又は営業損失（ ）	12,831,119
経常利益又は経常損失（ ）	12,831,119
当期純利益又は当期純損失（ ）	12,831,119
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（ ）	258,993
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	25,581,484
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	25,581,484
剰余金減少額又は欠損金増加額	669,262
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	669,262
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（ ）	37,484,348

（ 3 ）【注記表】

（重要な会計方針の注記）

項 目	第1期
	自 2023年3月24日 至 2024年3月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項 目	第1期
	（2024年3月18日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	202,763,721口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1849円 （1万口当たりの純資産額11,849円）

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項 目	第1期
	自 2023年3月24日 至 2024年3月18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（2,006,711円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（10,565,415円）、収益調整金（24,912,222円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は37,484,348円（1万口当たり1,848.67円）であります、分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自 2023年3月24日 至 2024年3月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、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1期 (2024年3月18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1期(自 2023年3月24日 至 2024年3月18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	15,915,569円
合計	15,915,569円

(デリバティブ取引に関する注記)

第1期(2024年3月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	47,932,703	-	48,799,991	867,288
	小計	47,932,703	-	48,799,991	867,288
合 計		47,932,703	-	48,799,991	867,288

(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)

第1期 自 2023年3月24日 至 2024年3月18日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

項 目	第1期 (2024年3月18日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	207,518,523円

期中一部解約元本額	5,754,802円
-----------	------------

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド	22,427,852	24,006,772	
	ゴールド・インデックス・マザーファンド	15,141,933	23,668,355	
	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	14,497,090	69,607,777	
	外国株式インデックス・マザーファンド	3,980,305	33,926,925	
	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	4,679,684	5,691,431	
	外国債券パッシブ・マザーファンド	7,206,277	16,043,334	
	国内債券パッシブ・マザーファンド	5,268,596	6,379,742	
	Jリート・インデックス・マザーファンド	19,202,498	48,096,496	
	外国リート・インデックス・マザーファンド	994,144	3,197,167	
	エマージング株式インデックス・マザーファンド	3,832,033	7,556,769	
	親投資信託受益証券 小計		238,174,768	
	合計		238,174,768	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

(参考)

「三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)」、「三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)」、「三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)」、「三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)」および「三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)」は、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「エマージング株式インデックス・マザーファンド」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」、「ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド」、「米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド」、「Jリート・インデックス・マザーファンド」、「外国リート・インデックス・マザーファンド」および「ゴールド・インデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

(1) 貸借対照表

(単位 : 円)

(2024年3月18日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	61,330,271
コール・ローン	2,288,137,486
株式	325,728,271,580
派生商品評価勘定	31,523,400
未収配当金	482,893,153
前払金	31,265,000
差入委託証拠金	131,336,518
流動資産合計	328,754,757,408
資産合計	328,754,757,408
負債の部	
流動負債	
未払解約金	262,280,365
その他未払費用	3,094
流動負債合計	262,283,459
負債合計	262,283,459
純資産の部	
元本等	
元本	68,414,614,168
剰余金	
剰余金又は欠損金()	260,077,859,781
元本等合計	328,492,473,949
純資産合計	328,492,473,949
負債純資産合計	328,754,757,408

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年3月24日 至 2024年3月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p>

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2024年3月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	68,414,614,168口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 4.8015円 (1万口当たりの純資産額48,015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3月24日 至 2024年3月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、先物取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

<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3月18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3月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物 0606月	2,834,186,600	-	2,865,710,000	31,523,400
	小計	2,834,186,600	-	2,865,710,000	31,523,400
合計		2,834,186,600	-	2,865,710,000	31,523,400

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2023年3月24日 至 2024年3月18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3月18日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	66,701,914,241円
同期中における追加設定元本額	12,000,194,205円
同期中における一部解約元本額	10,287,494,278円
2024年3月18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	9,559,118,745円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	933,472,194円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,219,468,910円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,574,118,763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)	126,842,629円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	3,203,821円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	13,614,089円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	52,376,274円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	152,283,274円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	143,550,909円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	265,512,453円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,354,756,235円
三井住友・DCつみたてN I S A・日本株インデックスファンド	27,412,656,387円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	211,867,016円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	291,634,028円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	165,170,599円

イオン・バランス戦略ファンド	62,920,367円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2050	54,325,145円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	194,819,214円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	199,716,157円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	781,960,428円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	467,364,214円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	556,059,498円
三井住友・D C つみたてN I S A ・世界分散ファンド	56,290,476円
三井住友D S ・国内株式インデックス年金ファンド	1,266,258,384円
三井住友D S ・年金バランス30(債券重点型)	38,733,500円
三井住友D S ・年金バランス50(標準型)	239,218,975円
三井住友D S ・年金バランス70(株式重点型)	262,741,120円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2060	5,758,119円
日興F W S ・日本株インデックス	2,288,918,530円
三井住友D S ・ T O P I X インデックス・ファンド	109,375,849円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2035	7,090,200円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2040	4,210,049円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2045	5,734,021円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2055	1,807,670円
三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2065	1,050,749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)	569,202円
三井住友D S ・ F W 専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	9,287,154円
三井住友D S ・ F W 専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	50,158,175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)	35,298,782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)	14,497,090円
S M A M ・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,228,313,580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 >	9,163,848円
S M A M ・ バランスファンドV A 安定成長型 < 適格機関投資家限定 >	41,808,833円
S M A M ・ バランスファンドV A 25 < 適格機関投資家専用 >	801,610,670円
S M A M ・ バランスファンドV A 37.5 < 適格機関投資家専用 >	1,046,599,954円
S M A M ・ バランスファンドV A 50 < 適格機関投資家専用 >	4,140,686,405円
S M A M ・ バランスファンドV L 30 < 適格機関投資家限定 >	28,176,463円
S M A M ・ バランスファンドV L 50 < 適格機関投資家限定 >	100,486,196円
S M A M ・ バランスファンドV A 75 < 適格機関投資家専用 >	573,525,116円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	30,970,130円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 25 < 適格機関投資家専用 >	172,458,319円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 50 < 適格機関投資家専用 >	578,015,629円
S M A M ・ バランスファンドV A 40 < 適格機関投資家専用 >	382,019,550円
S M A M ・ バランスファンドV A 35 < 適格機関投資家専用 >	1,114,585,238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 >	24,835,775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 >	26,064,359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 >	23,786,189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 >	13,492,163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 >	59,753,192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 >	152,355,733円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 20A2 < 適格機関投資家専用 >	32,537,804円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 35A2 < 適格機関投資家専用 >	29,459,650円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 50A2 < 適格機関投資家専用 >	6,584,711円

SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	28,335,632円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	360,779,838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)	151,542,165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>	139,929,666円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	56,504,391円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	42,475,230円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	28,268,521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>	38,577,357円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	20,403,150円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	32,596,587円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	601,941,108円
SMDAM・日米3資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	9,891,604円
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>	92,270,018円
合計	68,414,614,168円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

(単位:円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	4,100	3,750.000	15,375,000	
ニッスイ	119,400	961.800	114,838,920	
マルハニチロ	17,700	2,909.500	51,498,150	
雪国まいたけ	11,400	1,063.000	12,118,200	
カネコ種苗	4,800	1,425.000	6,840,000	
サカタのタネ	13,400	3,660.000	49,044,000	
ホクト	10,100	1,897.000	19,159,700	
住石ホールディングス	13,800	1,928.000	26,606,400	
日鉄鉱業	4,600	5,150.000	23,690,000	
三井松島ホールディングス	7,100	2,917.000	20,710,700	
INPEX	399,900	2,205.000	881,779,500	
石油資源開発	13,400	6,500.000	87,100,000	
K&Oエナジーグループ	5,500	2,521.000	13,865,500	
ショーボンドホールディングス	15,900	6,353.000	101,012,700	
ミライト・ワン	39,000	1,895.500	73,924,500	
タマホーム	7,600	4,130.000	31,388,000	
日本アクア	3,300	971.000	3,204,300	
安藤・間	66,700	1,225.000	81,707,500	
東急建設	34,200	835.000	28,557,000	
コムシスホールディングス	37,600	3,477.000	130,735,200	
ビーアールホールディングス	18,500	380.000	7,030,000	
高松コンストラクショングループ	8,200	2,880.000	23,616,000	
東建コーポレーション	3,200	9,480.000	30,336,000	

ヤマウラ	6,300	1,586.000	9,991,800
オリエンタル白石	44,000	396.000	17,424,000
大成建設	77,700	5,519.000	428,826,300
大林組	296,200	1,834.500	543,378,900
清水建設	236,400	972.000	229,780,800
飛鳥建設	9,400	1,560.000	14,664,000
長谷工コーポレーション	78,700	1,871.000	147,247,700
松井建設	9,700	950.000	9,215,000
銭高組	1,500	4,375.000	6,562,500
鹿島建設	183,500	3,080.000	565,180,000
不動テトラ	5,600	2,151.000	12,045,600
鉄建建設	6,700	2,573.000	17,239,100
西松建設	15,900	4,500.000	71,550,000
三井住友建設	65,600	432.000	28,339,200
大豊建設	3,800	3,585.000	13,623,000
奥村組	12,900	5,210.000	67,209,000
東鉄工業	10,900	3,055.000	33,299,500
浅沼組	6,200	4,265.000	26,443,000
戸田建設	112,800	1,019.500	114,999,600
熊谷組	13,400	4,045.000	54,203,000
北野建設	1,900	3,505.000	6,659,500
矢作建設工業	11,500	1,568.000	18,032,000
ピーエス三菱	10,900	1,053.000	11,477,700
日本ハウスホールディングス	19,500	315.000	6,142,500
新日本建設	11,500	1,582.000	18,193,000
東亜道路工業	3,400	6,380.000	21,692,000
日本道路	9,300	2,007.000	18,665,100
東亜建設工業	6,700	4,975.000	33,332,500
日本国土開発	24,300	517.000	12,563,100
若築建設	3,200	3,605.000	11,536,000
東洋建設	22,400	1,383.000	30,979,200
五洋建設	117,600	785.000	92,316,000
世紀東急工業	10,800	1,925.000	20,790,000
福田組	3,100	5,560.000	17,236,000
住友林業	71,600	4,212.000	301,579,200
巴コーポレーション	11,300	676.000	7,638,800
大和ハウス工業	228,700	4,396.000	1,005,365,200
ライト工業	15,400	1,933.000	29,768,200
積水ハウス	250,300	3,353.000	839,255,900
日特建設	6,800	1,151.000	7,826,800
北陸電気工事	4,700	1,203.000	5,654,100
ユアテック	17,800	1,417.000	25,222,600
日本リーテック	7,700	1,284.000	9,886,800
四電工	3,500	3,965.000	13,877,500
中電工	11,500	3,045.000	35,017,500
関電工	50,500	1,682.000	84,941,000
きんでん	58,200	2,755.000	160,341,000
東京エネシス	8,700	1,200.000	10,440,000

トーエネック	2,900	5,700.000	16,530,000
住友電設	7,400	3,280.000	24,272,000
日本電設工業	14,700	1,977.000	29,061,900
エクシオグループ	40,000	3,256.000	130,240,000
新日本空調	5,300	3,250.000	17,225,000
九電工	18,500	6,159.000	113,941,500
三機工業	16,900	2,078.000	35,118,200
日揮ホールディングス	82,900	1,500.500	124,391,450
中外炉工業	3,000	2,970.000	8,910,000
ヤマト	7,000	1,038.000	7,266,000
太平電業	5,000	4,360.000	21,800,000
高砂熱学工業	21,700	4,490.000	97,433,000
三晃金属工業	1,200	5,140.000	6,168,000
朝日工業社	4,000	3,595.000	14,380,000
明星工業	16,000	1,272.000	20,352,000
大気社	9,200	4,695.000	43,194,000
ダイダン	10,600	2,316.000	24,549,600
日比谷総合設備	6,400	2,871.000	18,374,400
テスホールディングス	19,300	469.000	9,051,700
インフロニア・ホールディングス	95,800	1,619.000	155,100,200
東洋エンジニアリング	12,300	892.000	10,971,600
レイズネクスト	11,600	2,280.000	26,448,000
ニッポン	23,300	2,394.000	55,780,200
日清製粉グループ本社	77,600	2,166.500	168,120,400
日東富士製粉	1,700	5,450.000	9,265,000
昭和産業	6,800	3,550.000	24,140,000
鳥越製粉	10,700	714.000	7,639,800
中部飼料	11,300	1,253.000	14,158,900
フィード・ワン	12,900	1,029.000	13,274,100
日本甜菜製糖	5,200	2,168.000	11,273,600
DM三井製糖ホールディングス	7,900	3,350.000	26,465,000
ウェルネオシュガー	4,700	2,354.000	11,063,800
森永製菓	35,500	2,647.500	93,986,250
中村屋	3,100	3,125.000	9,687,500
江崎グリコ	23,900	4,323.000	103,319,700
井村屋グループ	4,600	2,555.000	11,753,000
不二家	5,700	2,487.000	14,175,900
山崎製パン	56,000	4,000.000	224,000,000
モロゾフ	2,600	4,240.000	11,024,000
亀田製菓	5,100	4,335.000	22,108,500
寿スピリッツ	40,500	1,921.500	77,820,750
カルビー	38,300	3,418.000	130,909,400
森永乳業	29,600	3,115.000	92,204,000
六甲バター	6,300	1,379.000	8,687,700
ヤクルト本社	119,300	3,255.000	388,321,500
明治ホールディングス	102,200	3,410.000	348,502,000
雪印メグミルク	19,700	2,619.000	51,594,300
プリマハム	10,600	2,302.000	24,401,200

日本ハム	35,900	5,285.000	189,731,500
丸大食品	8,400	1,641.000	13,784,400
S Foods	8,900	3,235.000	28,791,500
柿安本店	3,000	2,878.000	8,634,000
伊藤ハム米久ホールディングス	12,100	4,180.000	50,578,000
サッポロホールディングス	27,600	6,363.000	175,618,800
アサヒグループホールディングス	192,000	5,488.000	1,053,696,000
キリンホールディングス	345,600	2,102.000	726,451,200
宝ホールディングス	57,100	1,114.000	63,609,400
オエノンホールディングス	26,200	359.000	9,405,800
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	65,900	2,233.500	147,187,650
ライフドリンク カンパニー	1,400	4,500.000	6,300,000
サントリー食品インターナショナル	58,600	4,941.000	289,542,600
ダイドーグループホールディングス	9,000	2,782.000	25,038,000
伊藤園	28,600	3,713.000	106,191,800
キーコーヒー	8,400	2,035.000	17,094,000
日清オイリオグループ	11,300	5,100.000	57,630,000
不二製油グループ本社	19,900	2,474.500	49,242,550
かどや製油	1,800	3,935.000	7,083,000
J - オイルミルズ	8,300	1,998.000	16,583,400
キッコーマン	55,200	9,840.000	543,168,000
味の素	197,500	5,468.000	1,079,930,000
ブルドックソース	4,700	2,195.000	10,316,500
キューピー	44,700	2,769.000	123,774,300
ハウス食品グループ本社	28,500	3,134.000	89,319,000
カゴメ	36,400	3,548.000	129,147,200
アリアケジャパン	8,200	5,370.000	44,034,000
エバラ食品工業	2,800	3,000.000	8,400,000
やまみ	900	3,530.000	3,177,000
ニチレイ	38,300	4,056.000	155,344,800
東洋水産	42,100	8,990.000	378,479,000
イトアンドホールディングス	4,100	2,021.000	8,286,100
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,000	1,259.000	6,295,000
日清食品ホールディングス	87,800	4,306.000	378,066,800
永谷園ホールディングス	4,200	2,276.000	9,559,200
フジッコ	7,600	1,937.000	14,721,200
ロック・フィールド	9,100	1,665.000	15,151,500
日本たばこ産業	504,900	3,901.000	1,969,614,900
ケンコーマヨネーズ	6,300	1,990.000	12,537,000
わらべや日洋ホールディングス	6,200	2,701.000	16,746,200
なとり	4,600	2,171.000	9,986,600
ファーマフーズ	12,200	895.000	10,919,000
ユーグレナ	52,500	620.000	32,550,000
紀文食品	7,100	1,246.000	8,846,600
ピククルスホールディングス	5,200	1,169.000	6,078,800
ミヨシ油脂	5,200	1,289.000	6,702,800
理研ビタミン	7,200	2,562.000	18,446,400

片倉工業	9,000	1,819.000	16,371,000
グンゼ	5,900	5,580.000	32,922,000
東洋紡	36,100	1,132.000	40,865,200
ユニチカ	30,500	173.000	5,276,500
富士紡ホールディングス	3,500	4,380.000	15,330,000
倉敷紡績	6,600	3,525.000	23,265,000
シキボウ	5,700	1,214.000	6,919,800
日本毛織	21,800	1,414.000	30,825,200
ダイドーリミテッド	8,100	707.000	5,726,700
帝国繊維	9,300	2,301.000	21,399,300
帝人	82,100	1,375.000	112,887,500
東レ	568,200	719.100	408,592,620
ダイニック	3,300	793.000	2,616,900
セーレン	16,000	2,574.000	41,184,000
小松マテーレ	13,300	769.000	10,227,700
ワコールホールディングス	17,500	3,686.000	64,505,000
ホギメディカル	11,200	3,825.000	42,840,000
T S Iホールディングス	28,800	734.000	21,139,200
ワールド	11,800	1,986.000	23,434,800
三陽商会	3,500	2,652.000	9,282,000
オンワードホールディングス	54,600	529.000	28,883,400
ルックホールディングス	3,700	2,594.000	9,597,800
ゴールドウイン	15,000	9,970.000	149,550,000
デサント	14,800	3,640.000	53,872,000
特種東海製紙	4,000	4,005.000	16,020,000
王子ホールディングス	357,100	611.700	218,438,070
日本製紙	43,100	1,175.000	50,642,500
北越コーポレーション	43,400	1,825.000	79,205,000
大王製紙	39,700	1,188.500	47,183,450
レンゴー	78,900	1,179.000	93,023,100
トーモク	5,400	2,617.000	14,131,800
ザ・パックス	6,200	3,580.000	22,196,000
北の達人コーポレーション	37,700	202.000	7,615,400
クラレ	123,400	1,567.500	193,429,500
旭化成	571,200	1,119.000	639,172,800
レゾナック・ホールディングス	82,100	3,450.000	283,245,000
住友化学	634,200	330.800	209,793,360
住友精化	3,500	5,050.000	17,675,000
日産化学	40,000	5,998.000	239,920,000
ラサ工業	3,400	2,562.000	8,710,800
クレハ	19,600	2,731.000	53,527,600
多木化学	3,300	3,705.000	12,226,500
テイカ	6,500	1,651.000	10,731,500
石原産業	14,800	1,634.000	24,183,200
日本曹達	9,100	6,030.000	54,873,000
東ソー	113,000	2,075.500	234,531,500
トクヤマ	29,000	2,588.500	75,066,500
セントラル硝子	9,900	2,826.000	27,977,400

東亜合成	41,100	1,548.500	63,643,350
大阪ソーダ	5,900	10,780.000	63,602,000
関東電化工業	16,400	989.000	16,219,600
デンカ	30,800	2,422.000	74,597,600
信越化学工業	758,300	6,639.000	5,034,353,700
日本カーバイド工業	3,100	1,897.000	5,880,700
堺化学工業	6,300	1,941.000	12,228,300
第一稀元素化学工業	8,000	955.000	7,640,000
エア・ウォーター	80,000	2,351.000	188,080,000
日本酸素ホールディングス	82,000	4,640.000	380,480,000
日本化学工業	3,000	2,369.000	7,107,000
日本パーカライジング	39,000	1,226.000	47,814,000
高压ガス工業	12,600	906.000	11,415,600
四国化成ホールディングス	11,000	1,785.000	19,635,000
戸田工業	2,700	1,758.000	4,746,600
ステラ ケミファ	4,800	3,865.000	18,552,000
保土谷化学工業	2,400	3,500.000	8,400,000
日本触媒	12,600	5,820.000	73,332,000
大日精化工業	5,800	2,773.000	16,083,400
カネカ	23,900	3,776.000	90,246,400
三菱瓦斯化学	62,900	2,580.000	162,282,000
三井化学	72,000	4,382.000	315,504,000
J S R	77,200	4,321.000	333,581,200
東京応化工業	42,000	4,447.000	186,774,000
大阪有機化学工業	6,900	3,300.000	22,770,000
三菱ケミカルグループ	616,900	914.900	564,401,810
K Hネオケム	13,300	2,213.000	29,432,900
ダイセル	110,600	1,467.500	162,305,500
住友ベークライト	12,200	8,977.000	109,519,400
積水化学工業	174,000	2,155.500	375,057,000
日本ゼオン	59,000	1,310.500	77,319,500
アイカ工業	22,000	3,639.000	80,058,000
U B E	41,900	2,618.000	109,694,200
積水樹脂	11,900	2,430.000	28,917,000
タキロンシーアイ	18,900	662.000	12,511,800
旭有機材	5,500	4,900.000	26,950,000
ニチバン	5,100	1,928.000	9,832,800
リケンテクノス	18,200	987.000	17,963,400
大倉工業	4,000	3,115.000	12,460,000
群栄化学工業	2,100	3,675.000	7,717,500
ミライアル	2,700	1,513.000	4,085,100
ダイキョーニシカワ	18,600	775.000	14,415,000
森六ホールディングス	4,400	2,777.000	12,218,800
恵和	6,100	1,106.000	6,746,600
日本化薬	69,000	1,317.500	90,907,500
カーリットホールディングス	8,700	1,016.000	8,839,200
日本精化	4,800	2,656.000	12,748,800
扶桑化学工業	8,800	5,070.000	44,616,000

トリケミカル研究所	10,500	5,000.000	52,500,000
A D E K A	30,000	3,280.000	98,400,000
日油	25,500	6,529.000	166,489,500
ハリマ化成グループ	5,800	911.000	5,283,800
花王	191,200	5,704.000	1,090,604,800
第一工業製薬	3,400	3,740.000	12,716,000
石原ケミカル	4,000	1,918.000	7,672,000
三洋化成工業	4,800	4,310.000	20,688,000
大日本塗料	9,700	1,149.000	11,145,300
日本ペイントホールディングス	450,200	1,107.000	498,371,400
関西ペイント	83,300	2,244.000	186,925,200
中国塗料	16,900	2,215.000	37,433,500
日本特殊塗料	5,200	1,378.000	7,165,600
藤倉化成	13,700	468.000	6,411,600
太陽ホールディングス	14,200	3,345.000	47,499,000
D I C	33,200	2,865.000	95,118,000
サカタインクス	18,300	1,500.000	27,450,000
a r t i e n c e	17,600	2,863.000	50,388,800
富士フイルムホールディングス	157,000	10,050.000	1,577,850,000
資生堂	177,200	4,223.000	748,315,600
ライオン	111,800	1,347.000	150,594,600
高砂香料工業	5,900	3,535.000	20,856,500
マンダム	17,900	1,326.000	23,735,400
ミルボン	11,700	3,275.000	38,317,500
ファンケル	37,500	2,107.000	79,012,500
コーセー	17,400	7,827.000	136,189,800
コタ	6,000	1,667.000	10,002,000
ポーラ・オルビスホールディングス	44,200	1,469.500	64,951,900
ノエビアホールディングス	7,300	5,160.000	37,668,000
新日本製薬	5,000	1,694.000	8,470,000
I - n e	1,900	1,935.000	3,676,500
アクシージア	4,800	793.000	3,806,400
エステー	5,900	1,581.000	9,327,900
アグロ カネショウ	4,400	1,250.000	5,500,000
コニシ	25,100	1,618.000	40,611,800
長谷川香料	15,800	3,180.000	50,244,000
小林製薬	25,000	6,145.000	153,625,000
荒川化学工業	7,700	1,160.000	8,932,000
メック	6,800	4,015.000	27,302,000
日本高純度化学	2,100	2,894.000	6,077,400
タカラバイオ	23,000	1,010.000	23,230,000
J C U	9,200	3,935.000	36,202,000
新田ゼラチン	6,000	796.000	4,776,000
O A T アグリオ	3,300	1,864.000	6,151,200
デクセリアルズ	21,400	6,067.000	129,833,800
アース製薬	7,400	4,355.000	32,227,000
北興化学工業	9,600	1,180.000	11,328,000
大成ラミック	3,500	3,025.000	10,587,500

クミアイ化学工業	33,600	822.000	27,619,200
日本農薬	15,900	757.000	12,036,300
アキレス	5,700	1,600.000	9,120,000
有沢製作所	14,400	1,159.000	16,689,600
日東電工	54,600	14,085.000	769,041,000
レック	12,300	1,120.000	13,776,000
三光合成	11,700	705.000	8,248,500
きもと	21,600	222.000	4,795,200
藤森工業	6,300	4,025.000	25,357,500
前澤化成工業	5,200	1,697.000	8,824,400
未来工業	3,200	4,400.000	14,080,000
J S P	6,000	2,244.000	13,464,000
エフピコ	16,500	2,737.000	45,160,500
天馬	6,100	2,341.000	14,280,100
信越ポリマー	17,400	1,549.000	26,952,600
東リ	18,200	404.000	7,352,800
ニフコ	26,000	3,883.000	100,958,000
バルカー	6,800	5,010.000	34,068,000
ユニ・チャーム	176,400	4,924.000	868,593,600
協和キリン	104,300	2,884.500	300,853,350
武田薬品工業	751,300	4,361.000	3,276,419,300
アステラス製薬	746,200	1,636.000	1,220,783,200
住友ファーマ	72,800	387.000	28,173,600
塩野義製薬	107,500	7,841.000	842,907,500
わかもと製薬	9,000	210.000	1,890,000
日本新薬	23,300	4,621.000	107,669,300
中外製薬	265,700	6,145.000	1,632,726,500
科研製薬	17,000	3,539.000	60,163,000
エーザイ	103,700	6,447.000	668,553,900
ロート製薬	83,400	3,116.000	259,874,400
小野薬品工業	181,900	2,515.000	457,478,500
久光製薬	20,200	3,989.000	80,577,800
持田製薬	11,300	3,275.000	37,007,500
参天製薬	158,000	1,447.000	228,626,000
扶桑薬品工業	4,500	2,320.000	10,440,000
ツムラ	29,500	3,658.000	107,911,000
キッセイ薬品工業	15,500	3,615.000	56,032,500
生化学工業	19,000	757.000	14,383,000
栄研化学	17,300	1,932.000	33,423,600
鳥居薬品	5,300	4,210.000	22,313,000
J C R ファーマ	31,800	873.000	27,761,400
東和薬品	14,500	2,858.000	41,441,000
富士製薬工業	7,900	1,671.000	13,200,900
ゼリア新薬工業	13,500	2,187.000	29,524,500
そーせいグループ	29,300	1,559.000	45,678,700
第一三共	738,300	4,936.000	3,644,248,800
杏林製薬	21,900	1,784.000	39,069,600
大幸薬品	24,400	379.000	9,247,600

ダイト	8,000	2,223.000	17,784,000
大塚ホールディングス	177,100	6,324.000	1,119,980,400
ペプチドリーム	43,500	1,375.500	59,834,250
セルソース	3,400	1,451.000	4,933,400
あすか製薬ホールディングス	9,900	2,117.000	20,958,300
サワイグループホールディングス	20,700	6,315.000	130,720,500
日本コークス工業	84,800	125.000	10,600,000
ニチレキ	10,500	2,495.000	26,197,500
ユシロ化学工業	5,900	2,112.000	12,460,800
富士石油	25,200	371.000	9,349,200
出光興産	471,600	1,023.500	482,682,600
E N E O Sホールディングス	1,336,700	709.200	947,987,640
コスモエネルギーホールディングス	25,400	7,221.000	183,413,400
横浜ゴム	42,800	4,054.000	173,511,200
TOYO TIRE	48,900	2,715.500	132,787,950
ブリヂストン	247,500	6,322.000	1,564,695,000
住友ゴム工業	83,500	1,761.500	147,085,250
藤倉コンポジット	5,600	1,420.000	7,952,000
オカモト	4,100	5,110.000	20,951,000
フコク	5,000	1,773.000	8,865,000
ニッタ	8,200	4,000.000	32,800,000
住友理工	13,800	1,275.000	17,595,000
三ツ星ベルト	10,500	4,825.000	50,662,500
バンドー化学	12,700	1,875.000	23,812,500
日東紡績	10,900	5,800.000	63,220,000
A G C	75,500	5,514.000	416,307,000
日本山村硝子	2,700	1,565.000	4,225,500
日本電気硝子	34,700	3,676.000	127,557,200
オハラ	5,300	1,322.000	7,006,600
住友大阪セメント	14,500	3,882.000	56,289,000
太平洋セメント	51,300	3,418.000	175,343,400
日本ヒューム	8,400	875.000	7,350,000
日本コンクリート工業	19,100	405.000	7,735,500
三谷セキサン	4,000	5,610.000	22,440,000
アジアパイルホールディングス	13,500	802.000	10,827,000
東海カーボン	78,500	970.300	76,168,550
日本カーボン	4,700	5,310.000	24,957,000
東洋炭素	6,100	8,050.000	49,105,000
ノリタケカンパニーリミテド	4,800	8,450.000	40,560,000
T O T O	56,000	4,271.000	239,176,000
日本碍子	98,200	1,994.500	195,859,900
日本特殊陶業	70,700	4,748.000	335,683,600
ダントーホールディングス	3,600	997.000	3,589,200
M A R U W A	3,200	31,400.000	100,480,000
品川リフラクトリーズ	10,700	1,924.000	20,586,800
黒崎播磨	1,800	13,970.000	25,146,000
ヨータイ	5,000	1,507.000	7,535,000
東京窯業	10,700	484.000	5,178,800

フジインコーポレーテッド	22,800	3,625.000	82,650,000
ニチアス	21,400	3,980.000	85,172,000
ニチハ	10,800	3,395.000	36,666,000
日本製鉄	389,800	3,627.000	1,413,804,600
神戸製鋼所	175,800	2,020.500	355,203,900
中山製鋼所	19,000	947.000	17,993,000
合同製鐵	4,600	5,770.000	26,542,000
J F E ホールディングス	242,700	2,489.500	604,201,650
東京製鐵	24,500	1,674.000	41,013,000
共英製鋼	9,600	2,389.000	22,934,400
大和工業	16,000	8,539.000	136,624,000
東京鐵鋼	4,000	5,350.000	21,400,000
大阪製鐵	5,300	2,188.000	11,596,400
淀川製鋼所	9,300	4,510.000	41,943,000
中部鋼鉄	5,900	2,637.000	15,558,300
丸一鋼管	26,400	3,960.000	104,544,000
モリ工業	2,000	5,590.000	11,180,000
大同特殊鋼	54,500	1,799.000	98,045,500
日本冶金工業	6,200	4,725.000	29,295,000
山陽特殊製鋼	8,800	2,288.000	20,134,400
愛知製鋼	5,100	3,825.000	19,507,500
日本金属	3,600	864.000	3,110,400
大平洋金属	8,100	1,390.000	11,259,000
新日本電工	48,000	315.000	15,120,000
栗本鐵工所	4,500	3,750.000	16,875,000
三菱製鋼	6,400	1,433.000	9,171,200
日本精線	1,300	6,530.000	8,489,000
エンビプロ・ホールディングス	6,800	532.000	3,617,600
新家工業	1,900	3,885.000	7,381,500
大紀アルミニウム工業所	12,200	1,231.000	15,018,200
日本軽金属ホールディングス	25,100	1,814.000	45,531,400
三井金属鉱業	25,700	4,559.000	117,166,300
三菱マテリアル	62,800	2,894.000	181,743,200
住友金属鉱山	101,500	4,409.000	447,513,500
D O W A ホールディングス	21,500	5,479.000	117,798,500
古河機械金属	12,900	1,791.000	23,103,900
大阪チタニウムテクノロジーズ	15,500	2,577.000	39,943,500
東邦チタニウム	18,600	1,526.000	28,383,600
U A C J	12,300	4,290.000	52,767,000
C K サンエツ	2,200	3,980.000	8,756,000
古河電気工業	29,600	3,143.000	93,032,800
住友電気工業	325,700	2,303.500	750,249,950
フジクラ	103,300	2,017.000	208,356,100
S W C C	9,700	3,640.000	35,308,000
平河ヒューテック	5,500	1,416.000	7,788,000
リョービ	9,700	2,834.000	27,489,800
アーレスティ	7,100	804.000	5,708,400
A R E ホールディングス	34,300	1,950.000	66,885,000

稲葉製作所	6,200	1,645.000	10,199,000
宮地エンジニアリンググループ	4,300	4,215.000	18,124,500
トーカロ	22,400	1,747.000	39,132,800
アルファ	3,900	1,641.000	6,399,900
SUMCO	155,400	2,372.000	368,608,800
川田テクノロジーズ	2,300	9,780.000	22,494,000
RS TECHNOLOGIES	5,900	2,692.000	15,882,800
信和	7,900	765.000	6,043,500
東洋製罐グループホールディングス	51,100	2,573.000	131,480,300
ホッカンホールディングス	5,100	1,925.000	9,817,500
横河ブリッジホールディングス	12,800	2,884.000	36,915,200
三和ホールディングス	87,200	2,577.000	224,714,400
文化シャッター	23,900	1,678.000	40,104,200
三協立山	11,100	890.000	9,879,000
アルインコ	7,600	1,032.000	7,843,200
LIXIL	136,700	1,953.000	266,975,100
ノーリツ	13,800	1,693.000	23,363,400
長府製作所	8,400	2,181.000	18,320,400
リンナイ	42,900	3,473.000	148,991,700
日東精工	13,700	607.000	8,315,900
岡部	16,300	748.000	12,192,400
ジーテクト	10,400	2,062.000	21,444,800
東ブレ	15,100	2,449.000	36,979,900
高周波熱錬	14,000	1,090.000	15,260,000
東京製綱	5,700	1,406.000	8,014,200
パイオラックス	11,500	2,679.000	30,808,500
エイチワン	9,600	699.000	6,710,400
日本発条	77,200	1,456.000	112,403,200
中央発條	4,000	1,078.000	4,312,000
立川ブラインド工業	4,400	1,521.000	6,692,400
三益半導体工業	7,500	3,075.000	23,062,500
日本製鋼所	23,500	2,960.500	69,571,750
三浦工業	35,600	2,954.500	105,180,200
タクマ	28,100	1,945.000	54,654,500
ツガミ	18,000	1,162.000	20,916,000
オークマ	7,800	7,254.000	56,581,200
芝浦機械	8,500	3,600.000	30,600,000
アマダ	134,800	1,728.000	232,934,400
アイダエンジニアリング	16,400	922.000	15,120,800
FUJ I	39,600	2,735.000	108,306,000
牧野フライス製作所	9,300	6,140.000	57,102,000
オーエスジー	38,200	2,127.000	81,251,400
旭ダイヤモンド工業	21,200	949.000	20,118,800
D M G 森精機	51,400	4,115.000	211,511,000
ソディック	22,400	729.000	16,329,600
ディスコ	41,000	50,890.000	2,086,490,000
日東工器	4,300	1,988.000	8,548,400
日進工具	7,100	998.000	7,085,800

富士ダイス	5,200	683.000	3,551,600
豊和工業	5,500	833.000	4,581,500
石川製作所	3,100	1,345.000	4,169,500
リケンN P R	9,200	2,953.000	27,167,600
島精機製作所	13,500	1,392.000	18,792,000
オプトラン	14,200	2,150.000	30,530,000
N C ホールディングス	2,000	1,807.000	3,614,000
イワキ	6,100	2,661.000	16,232,100
フリー	9,200	1,191.000	10,957,200
ヤマシンフィルタ	21,800	461.000	10,049,800
日阪製作所	8,800	1,027.000	9,037,600
やまびこ	13,300	1,878.000	24,977,400
野村マイクロ・サイエンス	2,900	18,280.000	53,012,000
平田機工	4,000	7,880.000	31,520,000
P E G A S U S	11,000	563.000	6,193,000
マルマエ	4,300	2,113.000	9,085,900
タツモ	5,300	3,855.000	20,431,500
ナブテスコ	53,900	2,627.500	141,622,250
三井海洋開発	11,000	3,030.000	33,330,000
レオン自動機	9,100	1,481.000	13,477,100
S M C	25,500	88,790.000	2,264,145,000
ホソカワミクロン	5,700	4,635.000	26,419,500
ユニオンツール	3,600	4,370.000	15,732,000
瑞光	6,500	1,508.000	9,802,000
オイレス工業	11,100	2,268.000	25,174,800
日精エー・エス・ビー機械	3,400	5,140.000	17,476,000
サトーホールディングス	11,600	2,309.000	26,784,400
技研製作所	8,100	2,040.000	16,524,000
日本エアーテック	5,400	1,166.000	6,296,400
日精樹脂工業	6,400	1,208.000	7,731,200
ワイエイシイホールディングス	3,100	2,418.000	7,495,800
小松製作所	399,500	4,375.000	1,747,812,500
住友重機械工業	50,200	4,580.000	229,916,000
日立建機	34,000	4,479.000	152,286,000
日工	11,000	777.000	8,547,000
巴工業	3,700	4,365.000	16,150,500
井関農機	8,400	1,025.000	8,610,000
T O W A	9,600	9,560.000	91,776,000
ローツェ	4,500	20,010.000	90,045,000
クボタ	445,500	2,272.000	1,012,176,000
荏原実業	4,400	3,610.000	15,884,000
三菱化工機	2,900	3,990.000	11,571,000
月島ホールディングス	11,500	1,408.000	16,192,000
帝国電機製作所	5,900	2,593.000	15,298,700
新東工業	16,700	1,140.000	19,038,000
澁谷工業	8,000	3,335.000	26,680,000
アイチコーポレーション	11,800	1,124.000	13,263,200
小森コーポレーション	20,900	1,276.000	26,668,400

鶴見製作所	6,300	3,685.000	23,215,500
酒井重工業	1,400	6,890.000	9,646,000
荏原製作所	34,900	12,960.000	452,304,000
西島製作所	7,600	2,667.000	20,269,200
北越工業	8,700	2,041.000	17,756,700
ダイキン工業	101,800	20,195.000	2,055,851,000
オルガノ	10,300	7,260.000	74,778,000
トーヨーカネツ	2,900	4,560.000	13,224,000
栗田工業	47,700	6,403.000	305,423,100
椿本チエイン	11,600	4,995.000	57,942,000
大同工業	6,300	773.000	4,869,900
木村化工機	8,700	700.000	6,090,000
アネスト岩田	13,200	1,283.000	16,935,600
ダイフク	144,100	3,371.000	485,761,100
サムコ	2,300	5,300.000	12,190,000
加藤製作所	3,200	1,484.000	4,748,800
タダノ	48,900	1,220.000	59,658,000
フジテック	20,500	3,866.000	79,253,000
C K D	23,900	3,200.000	76,480,000
平和	26,700	2,042.000	54,521,400
理想科学工業	7,100	3,185.000	22,613,500
S A N K Y O	98,000	1,672.000	163,856,000
日本金銭機械	10,300	1,290.000	13,287,000
マースグループホールディングス	4,800	3,195.000	15,336,000
フクシマガリレイ	5,900	5,890.000	34,751,000
ダイコク電機	4,600	4,020.000	18,492,000
竹内製作所	15,300	5,610.000	85,833,000
アマノ	23,900	3,917.000	93,616,300
J U K I	13,700	533.000	7,302,100
ジャノメ	9,400	708.000	6,655,200
マックス	10,800	3,265.000	35,262,000
グローリー	20,400	2,835.000	57,834,000
新晃工業	8,200	3,535.000	28,987,000
大和冷機工業	12,400	1,500.000	18,600,000
セガサミーホールディングス	76,700	1,904.000	146,036,800
T P R	9,600	2,180.000	20,928,000
ツバキ・ナカシマ	19,100	803.000	15,337,300
ホシザキ	50,200	5,440.000	273,088,000
大豊工業	9,000	922.000	8,298,000
日本精工	157,600	832.900	131,265,040
N T N	185,600	312.400	57,981,440
ジェイテクト	75,300	1,385.000	104,290,500
不二越	6,300	3,445.000	21,703,500
日本トムソン	20,600	650.000	13,390,000
T H K	49,400	3,341.000	165,045,400
ユーシン精機	7,900	682.000	5,387,800
前澤給装工業	6,900	1,316.000	9,080,400
イーグル工業	9,300	1,823.000	16,953,900

前澤工業	4,900	1,074.000	5,262,600
日本ピラー工業	7,800	5,780.000	45,084,000
キッツ	29,500	1,287.000	37,966,500
マキタ	97,900	4,056.000	397,082,400
三井E & S	43,000	1,941.000	83,463,000
日立造船	74,100	1,275.000	94,477,500
三菱重工業	149,100	12,615.000	1,880,896,500
I H I	64,000	3,597.000	230,208,000
スター精密	15,100	1,778.000	26,847,800
日清紡ホールディングス	64,200	1,203.500	77,264,700
イビデン	44,600	6,959.000	310,371,400
コニカミノルタ	193,300	496.600	95,992,780
ブラザー工業	114,100	2,649.500	302,307,950
ミネベアミツミ	148,400	2,931.500	435,034,600
日立製作所	409,700	12,700.000	5,203,190,000
三菱電機	949,000	2,474.000	2,347,826,000
富士電機	51,800	9,784.000	506,811,200
東洋電機製造	5,000	1,150.000	5,750,000
安川電機	92,700	6,337.000	587,439,900
シンフォニア テクノロジー	10,000	2,896.000	28,960,000
明電舎	15,500	2,784.000	43,152,000
オリジン	3,500	1,221.000	4,273,500
山洋電気	3,600	7,120.000	25,632,000
デンヨー	6,800	2,356.000	16,020,800
PHCホールディングス	16,400	1,281.000	21,008,400
KOKUSAI ELECTRIC	33,100	3,665.000	121,311,500
ソシオネクスト	62,100	3,905.000	242,500,500
東芝テック	11,300	3,050.000	34,465,000
芝浦メカトロニクス	5,000	6,520.000	32,600,000
マブチモーター	41,600	2,757.000	114,691,200
ニデック	188,500	5,881.000	1,108,568,500
トレックス・セミコンダクター	4,300	1,829.000	7,864,700
東光高岳	5,300	2,446.000	12,963,800
ダブル・スコープ	25,600	550.000	14,080,000
ダイヘン	8,300	9,110.000	75,613,000
ヤーマン	16,800	979.000	16,447,200
JVCケンウッド	69,200	917.000	63,456,400
ミマキエンジニアリング	9,000	1,079.000	9,711,000
I - P E X	6,200	1,769.000	10,967,800
大崎電気工業	21,000	676.000	14,196,000
オムロン	65,200	5,557.000	362,316,400
日東工業	11,200	4,340.000	48,608,000
I D E C	12,300	2,733.000	33,615,900
ジーエス・ユアサ コーポレーション	33,600	3,020.000	101,472,000
サクサホールディングス	1,700	3,155.000	5,363,500
メルコホールディングス	3,300	3,220.000	10,626,000
日本電気	112,000	10,955.000	1,226,960,000
富士通	78,500	25,130.000	1,972,705,000

沖電気工業	39,200	1,126.000	44,139,200
電気興業	3,700	2,108.000	7,799,600
サンケン電気	8,000	6,779.000	54,232,000
アイホン	4,900	2,982.000	14,611,800
ルネサスエレクトロニクス	556,800	2,508.500	1,396,732,800
セイコーエプソン	109,400	2,525.500	276,289,700
ワコム	64,900	677.000	43,937,300
アルバック	19,000	9,571.000	181,849,000
アクセル	4,400	2,156.000	9,486,400
E I Z O	6,100	5,220.000	31,842,000
日本信号	19,000	1,014.000	19,266,000
京三製作所	19,500	533.000	10,393,500
能美防災	11,200	2,280.000	25,536,000
ホーチキ	6,400	2,188.000	14,003,200
エレコム	20,000	1,552.000	31,040,000
パナソニック ホールディングス	1,007,700	1,416.000	1,426,903,200
シャープ	145,800	830.600	121,101,480
アンリツ	61,200	1,290.000	78,948,000
富士通ゼネラル	24,800	1,936.500	48,025,200
ソニーグループ	597,300	13,330.000	7,962,009,000
T D K	135,100	7,508.000	1,014,330,800
帝国通信工業	4,100	1,863.000	7,638,300
タムラ製作所	36,200	558.000	20,199,600
アルプスアルパイン	77,800	1,130.500	87,952,900
日本電波工業	10,800	1,290.000	13,932,000
鈴木	5,300	1,182.000	6,264,600
メイコー	8,900	5,380.000	47,882,000
日本トリム	2,200	3,880.000	8,536,000
フォスター電機	8,200	1,143.000	9,372,600
S M K	2,500	2,702.000	6,755,000
ヨコオ	7,300	1,529.000	11,161,700
ホシデン	19,300	1,914.000	36,940,200
ヒロセ電機	12,600	15,345.000	193,347,000
日本航空電子工業	20,500	2,585.000	52,992,500
T O A	10,100	1,157.000	11,685,700
マクセル	18,900	1,564.000	29,559,600
古野電気	11,500	2,190.000	25,185,000
スミダコーポレーション	11,500	1,204.000	13,846,000
アイコム	3,600	3,425.000	12,330,000
リオン	3,800	3,030.000	11,514,000
横河電機	93,400	3,424.000	319,801,600
新電元工業	3,400	3,095.000	10,523,000
アズビル	57,900	4,302.000	249,085,800
東亜ディーケーケー	5,600	969.000	5,426,400
日本光電工業	36,400	4,038.000	146,983,200
チノー	3,700	2,481.000	9,179,700
日本電子材料	6,500	2,824.000	18,356,000
堀場製作所	16,100	15,225.000	245,122,500

アドバンテスト	241,800	6,686.000	1,616,674,800
エスベック	7,100	2,915.000	20,696,500
キーエンス	84,500	70,550.000	5,961,475,000
日置電機	4,100	7,000.000	28,700,000
シスメックス	72,900	8,387.000	611,412,300
日本マイクロニクス	15,300	7,680.000	117,504,000
メガチップス	6,800	4,160.000	28,288,000
O B A R A G R O U P	5,900	3,700.000	21,830,000
コーセル	9,800	1,549.000	15,180,200
イリソ電子工業	7,700	3,080.000	23,716,000
オブテックスグループ	15,100	1,829.000	27,617,900
千代田インテグレ	3,800	2,638.000	10,024,400
レーザーテック	38,700	40,420.000	1,564,254,000
スタンレー電気	54,100	2,717.000	146,989,700
ウシオ電機	43,300	2,014.000	87,206,200
ヘリオス テクノ ホールディング	6,200	545.000	3,379,000
日本セラミック	7,500	2,704.000	20,280,000
遠藤照明	3,200	1,511.000	4,835,200
古河電池	6,300	995.000	6,268,500
山一電機	7,300	2,287.000	16,695,100
図研	7,200	4,540.000	32,688,000
日本電子	21,200	6,187.000	131,164,400
カシオ計算機	61,600	1,256.000	77,369,600
ファナック	411,700	4,372.000	1,799,952,400
日本シイエムケイ	19,800	612.000	12,117,600
エンプラス	2,600	8,070.000	20,982,000
大真空	12,100	816.000	9,873,600
ローム	156,500	2,491.500	389,919,750
浜松ホトニクス	67,600	5,424.000	366,662,400
三井ハイテック	7,400	8,749.000	64,742,600
新光電気工業	29,100	5,732.000	166,801,200
京セラ	524,400	2,082.500	1,092,063,000
太陽誘電	41,500	3,514.000	145,831,000
村田製作所	767,800	2,904.000	2,229,691,200
双葉電子工業	17,400	503.000	8,752,200
北陸電気工業	3,200	1,415.000	4,528,000
ニチコン	21,200	1,272.000	26,966,400
K O A	12,700	1,463.000	18,580,100
市光工業	15,900	566.000	8,999,400
小糸製作所	89,100	1,991.500	177,442,650
ミツバ	16,200	1,520.000	24,624,000
S C R E E Nホールディングス	28,800	18,340.000	528,192,000
キヤノン電子	9,100	2,371.000	21,576,100
キヤノン	421,100	4,437.000	1,868,420,700
リコー	212,400	1,299.500	276,013,800
象印マホービン	23,500	1,449.000	34,051,500
東京エレクトロン	178,700	36,740.000	6,565,438,000
イノテック	5,400	1,985.000	10,719,000

トヨタ紡織	35,100	2,501.500	87,802,650
ユニプレス	15,100	1,169.000	17,651,900
豊田自動織機	72,100	14,950.000	1,077,895,000
モリタホールディングス	14,600	1,668.000	24,352,800
三櫻工業	13,000	1,063.000	13,819,000
デンソー	696,000	2,808.000	1,954,368,000
東海理化電機製作所	22,700	2,527.000	57,362,900
川崎重工業	69,200	4,790.000	331,468,000
名村造船所	21,500	2,027.000	43,580,500
日本車輛製造	3,300	2,376.000	7,840,800
三菱ロジスネクスト	15,200	1,719.000	26,128,800
日産自動車	1,140,700	605.300	690,465,710
いすゞ自動車	245,200	2,035.500	499,104,600
トヨタ自動車	4,636,000	3,567.000	16,536,612,000
日野自動車	130,700	506.000	66,134,200
三菱自動車工業	331,500	479.700	159,020,550
武蔵精密工業	20,200	1,625.000	32,825,000
日産車体	12,500	956.000	11,950,000
新明和工業	25,900	1,192.000	30,872,800
極東開発工業	13,900	2,664.000	37,029,600
トピー工業	7,100	2,932.000	20,817,200
ティラド	2,400	3,810.000	9,144,000
タチエス	14,900	1,966.000	29,293,400
N O K	33,200	2,073.500	68,840,200
フタバ産業	23,900	1,115.000	26,648,500
カヤバ	7,800	5,080.000	39,624,000
大同メタル工業	19,500	688.000	13,416,000
プレス工業	36,200	674.000	24,398,800
ミクニ	10,000	476.000	4,760,000
太平洋工業	18,400	1,553.000	28,575,200
アイシン	65,200	5,750.000	374,900,000
マツダ	279,800	1,714.500	479,717,100
今仙電機製作所	6,300	652.000	4,107,600
本田技研工業	2,058,100	1,830.500	3,767,352,050
スズキ	155,000	6,318.000	979,290,000
S U B A R U	261,300	3,267.000	853,667,100
安永	4,400	723.000	3,181,200
ヤマハ発動機	364,200	1,366.500	497,679,300
エクセディ	13,000	3,000.000	39,000,000
豊田合成	23,800	3,207.000	76,326,600
愛三工業	14,000	1,591.000	22,274,000
日本プラスト	10,500	554.000	5,817,000
ヨロズ	9,500	993.000	9,433,500
エフ・シー・シー	14,200	2,155.000	30,601,000
シマノ	34,200	22,450.000	767,790,000
テイ・エス テック	32,200	1,972.000	63,498,400
ジャムコ	4,100	1,292.000	5,297,200
テルモ	235,900	5,808.000	1,370,107,200

日機装	19,100	1,222.000	23,340,200
日本エム・ディ・エム	5,400	720.000	3,888,000
島津製作所	111,900	4,366.000	488,555,400
長野計器	6,200	2,308.000	14,309,600
ブイ・テクノロジー	4,600	2,470.000	11,362,000
東京計器	6,700	2,451.000	16,421,700
愛知時計電機	3,800	2,426.000	9,218,800
インターアクション	5,200	1,231.000	6,401,200
オーバル	7,300	550.000	4,015,000
東京精密	17,500	11,310.000	197,925,000
マニー	33,800	2,040.000	68,952,000
ニコン	122,500	1,575.500	192,998,750
トプコン	42,400	1,752.000	74,284,800
オリンパス	519,500	2,177.000	1,130,951,500
理研計器	5,800	7,580.000	43,964,000
タムロン	5,200	6,770.000	35,204,000
HOYA	166,200	19,445.000	3,231,759,000
ノーリツ鋼機	8,000	3,105.000	24,840,000
A & Dホロンホールディングス	11,900	2,462.000	29,297,800
朝日インテック	103,100	2,902.500	299,247,750
シチズン時計	78,100	1,000.000	78,100,000
リズム	1,300	4,005.000	5,206,500
メニコン	29,600	1,654.000	48,958,400
松風	3,900	2,952.000	11,512,800
セイコーグループ	12,400	3,975.000	49,290,000
ニプロ	70,800	1,200.000	84,960,000
パラマウントベッドホールディングス	18,900	2,611.000	49,347,900
トランザクション	5,600	2,339.000	13,098,400
ニホンフラッシュ	8,600	958.000	8,238,800
前田工織	7,000	3,730.000	26,110,000
永大産業	17,800	297.000	5,286,600
アートネイチャー	9,800	783.000	7,673,400
フルヤ金属	2,100	10,430.000	21,903,000
バンダイナムコホールディングス	232,000	2,845.000	660,040,000
SHOEI	18,700	2,214.000	41,401,800
フランスベッドホールディングス	10,500	1,309.000	13,744,500
パイロットコーポレーション	12,400	3,807.000	47,206,800
萩原工業	6,300	1,547.000	9,746,100
フジシールインターナショナル	17,100	1,966.000	33,618,600
タカラトミー	38,600	2,804.000	108,234,400
広済堂ホールディングス	22,400	690.000	15,456,000
プロネクサス	7,700	1,246.000	9,594,200
TOPPANホールディングス	104,100	3,619.000	376,737,900
大日本印刷	92,400	4,586.000	423,746,400
共同印刷	2,800	3,295.000	9,226,000
NISSHA	15,100	1,417.000	21,396,700
TAKARA & COMPANY	5,300	2,731.000	14,474,300
アシックス	72,100	6,751.000	486,747,100

ツツミ	3,200	2,143.000	6,857,600
ローランド	6,300	4,835.000	30,460,500
小松ウオール工業	3,300	3,300.000	10,890,000
ヤマハ	53,700	3,185.000	171,034,500
河合楽器製作所	2,500	3,550.000	8,875,000
クリナップ	9,800	785.000	7,693,000
ビジョン	54,800	1,544.000	84,611,200
キングジム	8,800	890.000	7,832,000
リンテック	16,700	3,210.000	53,607,000
イトーキ	17,400	1,609.000	27,996,600
任天堂	533,100	8,286.000	4,417,266,600
三菱鉛筆	12,000	2,470.000	29,640,000
タカラスタндарт	17,700	1,888.000	33,417,600
コクヨ	36,200	2,481.000	89,812,200
グローブライド	7,000	2,025.000	14,175,000
オカムラ	25,200	2,212.000	55,742,400
美津濃	8,400	5,920.000	49,728,000
東京電力ホールディングス	763,200	828.900	632,616,480
中部電力	310,400	1,972.000	612,108,800
関西電力	325,700	2,112.000	687,878,400
中国電力	146,200	1,129.500	165,132,900
北陸電力	86,900	781.500	67,912,350
東北電力	221,100	1,142.500	252,606,750
四国電力	77,300	1,172.000	90,595,600
九州電力	193,800	1,316.500	255,137,700
北海道電力	80,600	757.000	61,014,200
沖縄電力	20,600	1,139.000	23,463,400
電源開発	69,300	2,429.000	168,329,700
エフオン	9,900	435.000	4,306,500
イーレックス	16,400	710.000	11,644,000
レノバ	23,200	1,191.000	27,631,200
東京瓦斯	178,700	3,549.000	634,206,300
大阪瓦斯	171,200	3,418.000	585,161,600
東邦瓦斯	36,700	3,223.000	118,284,100
北海道瓦斯	4,900	2,465.000	12,078,500
広島ガス	19,100	391.000	7,468,100
西部ガスホールディングス	7,800	1,934.000	15,085,200
静岡ガス	18,000	971.000	17,478,000
メタウォーター	9,800	2,264.000	22,187,200
S B Sホールディングス	7,200	2,391.000	17,215,200
東武鉄道	92,100	3,893.000	358,545,300
相鉄ホールディングス	29,800	2,761.000	82,277,800
東急	235,800	1,974.500	465,587,100
京浜急行電鉄	103,200	1,337.000	137,978,400
小田急電鉄	139,600	2,158.000	301,256,800
京王電鉄	41,900	4,212.000	176,482,800
京成電鉄	54,400	6,288.000	342,067,200
富士急行	10,300	3,985.000	41,045,500

東日本旅客鉄道	155,000	8,954.000	1,387,870,000
西日本旅客鉄道	100,900	6,390.000	644,751,000
東海旅客鉄道	324,900	3,951.000	1,283,679,900
西武ホールディングス	102,400	2,224.000	227,737,600
鴻池運輸	14,000	2,035.000	28,490,000
西日本鉄道	21,600	2,447.500	52,866,000
ハマキョウレックス	6,300	3,740.000	23,562,000
サカイ引越センター	9,100	2,557.000	23,268,700
近鉄グループホールディングス	84,000	4,589.000	385,476,000
阪急阪神ホールディングス	112,000	4,427.000	495,824,000
南海電気鉄道	39,300	3,126.000	122,851,800
京阪ホールディングス	46,300	3,457.000	160,059,100
神戸電鉄	2,700	2,889.000	7,800,300
名古屋鉄道	89,800	2,200.500	197,604,900
山陽電気鉄道	6,400	2,159.000	13,817,600
アルプス物流	6,700	2,775.000	18,592,500
ヤマトホールディングス	108,400	2,156.500	233,764,600
山九	21,500	5,298.000	113,907,000
丸全昭和運輸	5,000	4,620.000	23,100,000
センコーグループホールディングス	42,900	1,138.000	48,820,200
トナミホールディングス	1,900	4,520.000	8,588,000
ニッコンホールディングス	26,300	2,988.000	78,584,400
福山通運	9,700	3,710.000	35,987,000
セイノーホールディングス	47,800	2,175.000	103,965,000
神奈川中央交通	2,600	3,085.000	8,021,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	21,800	1,369.000	29,844,200
C & F ロジホールディングス	8,300	2,000.000	16,600,000
九州旅客鉄道	59,000	3,554.000	209,686,000
S Gホールディングス	143,300	1,927.000	276,139,100
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	28,600	7,624.000	218,046,400
日本郵船	240,800	4,429.000	1,066,503,200
商船三井	182,300	4,819.000	878,503,700
川崎汽船	67,800	6,534.000	443,005,200
N Sユナイテッド海運	4,700	5,140.000	24,158,000
明海グループ	7,400	796.000	5,890,400
飯野海運	31,300	1,282.000	40,126,600
乾汽船	12,600	1,083.000	13,645,800
日本航空	207,600	2,797.000	580,657,200
A N Aホールディングス	228,500	3,206.000	732,571,000
トランコム	2,400	5,960.000	14,304,000
日新	6,500	2,776.000	18,044,000
三菱倉庫	20,500	4,767.000	97,723,500
三井倉庫ホールディングス	7,600	4,595.000	34,922,000
住友倉庫	21,500	2,559.000	55,018,500
滋澤倉庫	3,300	3,055.000	10,081,500
東陽倉庫	3,700	1,528.000	5,653,600
日本トランスシティ	16,800	645.000	10,836,000

川西倉庫	5,200	1,222.000	6,354,400
安田倉庫	6,500	1,227.000	7,975,500
上組	39,000	3,375.000	131,625,000
キムラユニティー	4,000	1,644.000	6,576,000
キューソー流通システム	6,700	1,041.000	6,974,700
エーアイテイー	5,400	1,725.000	9,315,000
内外トランスライン	3,500	2,398.000	8,393,000
日本コンセプト	3,300	1,804.000	5,953,200
N E C ネットズエスアイ	32,200	2,611.000	84,074,200
クロスキャット	5,200	1,837.000	9,552,400
システナ	134,900	280.000	37,772,000
デジタルアーツ	5,300	4,495.000	23,823,500
日鉄ソリューションズ	14,100	5,140.000	72,474,000
キューブシステム	3,500	1,111.000	3,888,500
コア	3,300	1,972.000	6,507,600
手間いらず	1,900	3,185.000	6,051,500
ラクーンホールディングス	8,100	564.000	4,568,400
ソリトンシステムズ	4,800	1,300.000	6,240,000
ソフトクリエイティブホールディングス	7,100	1,942.000	13,788,200
T I S	92,700	3,424.000	317,404,800
グリー	23,300	487.000	11,347,100
コーエーテクモホールディングス	53,200	1,807.500	96,159,000
三菱総合研究所	3,900	5,070.000	19,773,000
ファインデックス	7,900	1,185.000	9,361,500
ブレインパッド	7,400	1,464.000	10,833,600
K L a b	9,100	364.000	3,312,400
ポルトゥウィンホールディングス	15,000	502.000	7,530,000
ネクソン	190,100	2,570.000	488,557,000
アイスタイル	29,200	538.000	15,709,600
エムアップホールディングス	10,900	1,172.000	12,774,800
エイチーム	6,700	650.000	4,355,000
エニグモ	12,700	410.000	5,207,000
コロプラ	32,000	597.000	19,104,000
ブロードリーフ	42,900	535.000	22,951,500
デジタルハーツホールディングス	5,700	947.000	5,397,900
メディアドゥ	4,300	1,449.000	6,230,700
じげん	24,900	599.000	14,915,100
フィックスターズ	9,800	2,268.000	22,226,400
C A R T A H O L D I N G S	4,400	1,515.000	6,666,000
オブティム	8,500	1,088.000	9,248,000
セレス	3,800	1,635.000	6,213,000
S H I F T	5,700	25,425.000	144,922,500
ティーガイア	9,000	2,090.000	18,810,000
セック	1,000	5,150.000	5,150,000
テクマトリックス	15,700	1,959.000	30,756,300
プロシップ	3,900	1,505.000	5,869,500
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	22,400	2,221.500	49,761,600
G M O ペイメントゲートウェイ	17,100	9,940.000	169,974,000

システムリサーチ	2,800	3,290.000	9,212,000
インターネットイニシアティブ	41,200	2,947.500	121,437,000
さくらインターネット	9,600	7,140.000	68,544,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2,700	2,957.000	7,983,900
SRAホールディングス	4,200	3,975.000	16,695,000
朝日ネット	5,600	638.000	3,572,800
eBASE	12,200	752.000	9,174,400
アバントグループ	10,700	1,296.000	13,867,200
アドソル日進	3,500	1,695.000	5,932,500
フリービット	4,600	1,431.000	6,582,600
コムチュア	11,700	2,049.000	23,973,300
アイル	4,000	3,255.000	13,020,000
マークライズ	4,700	3,255.000	15,298,500
メディカル・データ・ビジョン	12,600	581.000	7,320,600
テラスカイ	4,100	1,496.000	6,133,600
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,700	1,822.000	8,563,400
PR TIMES	2,200	1,957.000	4,305,400
ラクス	40,200	2,148.000	86,349,600
ダブルスタンダード	3,400	1,880.000	6,392,000
オープンドア	6,300	815.000	5,134,500
アカツキ	4,400	2,540.000	11,176,000
UBICOMホールディングス	3,100	1,306.000	4,048,600
カナミックネットワーク	11,900	496.000	5,902,400
チェンジホールディングス	19,600	1,250.000	24,500,000
オークネット	3,500	2,329.000	8,151,500
マクロミル	17,000	765.000	13,005,000
オロ	3,600	2,766.000	9,957,600
ユーザーローカル	3,700	2,565.000	9,490,500
マネーフォワード	19,100	6,119.000	116,872,900
SUN ASTERISK	6,600	923.000	6,091,800
プラスアルファ・コンサルティング	5,200	2,385.000	12,402,000
電算システムホールディングス	4,200	2,618.000	10,995,600
APPIER GROUP	29,400	1,625.000	47,775,000
ビジョナル	6,600	8,900.000	58,740,000
プロトコーポレーション	9,900	1,389.000	13,751,100
野村総合研究所	187,700	4,182.000	784,961,400
日本システム技術	2,800	3,840.000	10,752,000
インテージホールディングス	9,600	1,603.000	15,388,800
インフォコム	10,700	2,858.000	30,580,600
シンプレクス・ホールディングス	13,500	2,846.000	38,421,000
HEROZ	4,100	1,859.000	7,621,900
ラクスル	21,400	1,203.000	25,744,200
メルカリ	42,500	1,978.000	84,065,000
IPS	2,900	2,505.000	7,264,500
システムサポート	3,300	2,019.000	6,662,700
イーソル	7,500	858.000	6,435,000
ウイングアーク1st	9,000	3,105.000	27,945,000

サーバーワークス	2,100	3,710.000	7,791,000
Sansan	28,400	1,755.000	49,842,000
ギフトィ	8,000	1,379.000	11,032,000
メドレー	11,400	4,820.000	54,948,000
ベース	3,100	3,420.000	10,602,000
JMDC	14,800	3,575.000	52,910,000
フォーカスシステムズ	6,000	1,305.000	7,830,000
クレスコ	7,000	2,096.000	14,672,000
フジ・メディア・ホールディングス	82,000	1,832.500	150,265,000
オービック	28,300	23,010.000	651,183,000
ジャストシステム	12,300	2,724.000	33,505,200
TDCソフト	7,200	2,344.000	16,876,800
LINEヤフー	1,209,600	394.000	476,582,400
トレンドマイクロ	40,200	7,709.000	309,901,800
IDホールディングス	5,900	1,530.000	9,027,000
日本オラクル	16,600	12,160.000	201,856,000
アルファシステムズ	2,500	3,325.000	8,312,500
フューチャー	18,500	1,689.000	31,246,500
CAC HOLDINGS	4,300	1,855.000	7,976,500
SBテクノロジー	3,700	2,104.000	7,784,800
オービックビジネスコンサルタント	12,300	7,045.000	86,653,500
アイティフォー	10,900	1,330.000	14,497,000
東計電算	2,800	3,565.000	9,982,000
大塚商会	42,100	6,739.000	283,711,900
サイボウズ	12,000	1,882.000	22,584,000
電通総研	10,200	5,170.000	52,734,000
ACCESS	10,400	1,627.000	16,920,800
デジタルガレージ	14,300	3,420.000	48,906,000
イーエムシステムズ	14,500	752.000	10,904,000
ウェザーニューズ	2,500	5,150.000	12,875,000
CIJ	14,700	787.000	11,568,900
ビジネスエンジニアリング	1,500	3,860.000	5,790,000
WOWOW	7,000	1,142.000	7,994,000
スカラ	7,900	741.000	5,853,900
ANYCOLOR	9,100	2,594.000	23,605,400
IMAGICA GROUP	8,500	683.000	5,805,500
ネットワンシステムズ	34,800	2,788.500	97,039,800
アルゴグラフィックス	7,500	4,400.000	33,000,000
マーベラス	14,200	719.000	10,209,800
エイベックス	14,200	1,306.000	18,545,200
BIPROGY	27,800	4,739.000	131,744,200
都築電気	4,500	2,403.000	10,813,500
TBSホールディングス	42,800	4,004.000	171,371,200
日本テレビホールディングス	75,600	2,072.500	156,681,000
朝日放送グループホールディングス	9,600	670.000	6,432,000
テレビ朝日ホールディングス	20,800	1,975.000	41,080,000
スカパーJSATホールディングス	67,900	947.000	64,301,300
テレビ東京ホールディングス	6,000	2,982.000	17,892,000

日本BS放送	3,500	893.000	3,125,500
ビジョン	12,800	1,212.000	15,513,600
USEN-NEXT HOLDINGS	9,400	5,020.000	47,188,000
日本通信	83,500	211.000	17,618,500
日本電信電話	25,179,100	180.900	4,554,899,190
KDDI	654,100	4,554.000	2,978,771,400
ソフトバンク	1,361,800	1,977.500	2,692,959,500
光通信	8,600	27,015.000	232,329,000
エムティーアイ	7,400	796.000	5,890,400
GMOインターネットグループ	31,300	2,841.000	88,923,300
ファイバーゲート	5,000	1,080.000	5,400,000
KADOKAWA	44,800	2,945.500	131,958,400
学研ホールディングス	14,400	947.000	13,636,800
ゼンリン	14,500	859.000	12,455,500
アイネット	5,600	2,197.000	12,303,200
松竹	4,700	10,110.000	47,517,000
東宝	47,200	5,079.000	239,728,800
東映	2,800	19,350.000	54,180,000
NTTデータグループ	222,500	2,441.000	543,122,500
ピー・シー・エー	5,200	1,768.000	9,193,600
ビジネスブレイン太田昭和	3,300	2,164.000	7,141,200
DTS	17,200	4,110.000	70,692,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	39,100	6,289.000	245,899,900
シーイーシー	11,700	1,597.000	18,684,900
カプコン	75,800	6,144.000	465,715,200
アイ・エス・ピー	4,600	1,386.000	6,375,600
ジャステック	5,100	1,450.000	7,395,000
SCSK	59,000	2,880.000	169,920,000
NSW	3,300	3,150.000	10,395,000
アイネス	6,300	1,597.000	10,061,100
TKC	12,700	3,795.000	48,196,500
富士ソフト	17,200	6,220.000	106,984,000
NSD	29,700	2,972.000	88,268,400
コナミグループ	32,000	10,260.000	328,320,000
福井コンピュータホールディングス	5,200	2,650.000	13,780,000
JBCホールディングス	5,900	3,335.000	19,676,500
ミロク情報サービス	7,900	1,838.000	14,520,200
ソフトバンクグループ	417,900	8,790.000	3,673,341,000
高千穂交易	2,600	3,925.000	10,205,000
伊藤忠食品	2,000	7,440.000	14,880,000
エレマテック	8,000	1,895.000	15,160,000
あらた	13,400	3,235.000	43,349,000
トーメンデバイス	1,400	5,740.000	8,036,000
東京エレクトロン デバイス	9,000	6,500.000	58,500,000
円谷フィールズホールディングス	15,700	1,600.000	25,120,000
双日	99,500	3,972.000	395,214,000
アルフレッサ ホールディングス	90,200	2,264.500	204,257,900
横浜冷凍	24,300	1,072.000	26,049,600

ラサ商事	5,000	1,999.000	9,995,000
アルコニックス	12,000	1,449.000	17,388,000
神戸物産	69,400	3,914.000	271,631,600
あい ホールディングス	13,800	2,335.000	32,223,000
ダイワボウホールディングス	39,700	2,565.000	101,830,500
マクニカホールディングス	21,200	7,438.000	157,685,600
ラクト・ジャパン	3,800	2,330.000	8,854,000
グリムス	3,800	2,170.000	8,246,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	13,400	1,282.000	17,178,800
八洲電機	7,700	1,608.000	12,381,600
メディアスホールディングス	7,000	754.000	5,278,000
レスターホールディングス	8,000	2,914.000	23,312,000
ジオリーブグループ	3,000	1,430.000	4,290,000
大光	8,900	655.000	5,829,500
T O K A Iホールディングス	42,400	999.000	42,357,600
三洋貿易	9,900	1,233.000	12,206,700
ビューティガレージ	3,000	2,329.000	6,987,000
ウイン・パートナーズ	5,200	1,257.000	6,536,400
シップヘルスケアホールディングス	32,800	2,197.000	72,061,600
コメダホールディングス	21,600	2,726.000	58,881,600
フルサト・マルカホールディングス	8,300	2,190.000	18,177,000
ヤマエグループホールディングス	6,100	2,765.000	16,866,500
小野建	8,700	1,863.000	16,208,100
南陽	2,500	2,623.000	6,557,500
佐鳥電機	4,600	2,420.000	11,132,000
エコートレーディング	2,500	1,240.000	3,100,000
伯東	5,000	5,790.000	28,950,000
コンドーテック	7,000	1,291.000	9,037,000
ナガイレーベン	11,000	2,377.000	26,147,000
三菱食品	9,300	5,430.000	50,499,000
松田産業	6,800	2,542.000	17,285,600
第一興商	34,400	1,979.500	68,094,800
メディバルホールディングス	91,200	2,287.500	208,620,000
S P K	4,200	2,003.000	8,412,600
萩原電気ホールディングス	4,300	4,325.000	18,597,500
アズワン	14,100	5,596.000	78,903,600
スズデン	3,800	2,179.000	8,280,200
尾家産業	2,500	1,750.000	4,375,000
シモジマ	6,600	1,370.000	9,042,000
ドウシシャ	8,800	2,102.000	18,497,600
高速	4,900	2,327.000	11,402,300
たけびし	3,400	1,965.000	6,681,000
リックス	2,000	3,850.000	7,700,000
丸文	8,300	1,466.000	12,167,800
ハピネット	7,900	3,065.000	24,213,500
日本ライフライン	25,900	1,259.000	32,608,100
タカショー	11,900	521.000	6,199,900
I D O M	26,300	1,005.000	26,431,500

進和	5,800	2,589.000	15,016,200
ダイترون	3,600	3,375.000	12,150,000
シークス	12,500	1,697.000	21,212,500
オーハシテクニカ	4,700	1,706.000	8,018,200
白銅	2,600	2,623.000	6,819,800
伊藤忠商事	600,100	6,469.000	3,882,046,900
丸紅	743,900	2,507.500	1,865,329,250
長瀬産業	40,500	2,573.500	104,226,750
蝶理	5,500	3,340.000	18,370,000
豊田通商	78,200	9,780.000	764,796,000
三共生興	14,800	780.000	11,544,000
兼松	35,400	2,484.000	87,933,600
三井物産	672,800	6,645.000	4,470,756,000
日本紙パルプ商事	4,600	5,390.000	24,794,000
カメイ	9,500	2,096.000	19,912,000
スターゼン	6,200	2,836.000	17,583,200
山善	26,300	1,342.000	35,294,600
椿本興業	2,000	6,990.000	13,980,000
住友商事	539,800	3,541.000	1,911,431,800
内田洋行	3,500	6,990.000	24,465,000
三菱商事	1,716,100	3,420.000	5,869,062,000
第一実業	9,200	2,142.000	19,706,400
キヤノンマーケティングジャパン	20,700	4,487.000	92,880,900
西華産業	4,000	3,355.000	13,420,000
佐藤商事	6,200	1,776.000	11,011,200
菱洋エレクトロ	8,300	3,850.000	31,955,000
東京産業	8,900	731.000	6,505,900
ユアサ商事	7,300	4,985.000	36,390,500
神鋼商事	2,300	7,010.000	16,123,000
阪和興業	15,800	5,740.000	90,692,000
正栄食品工業	5,900	4,740.000	27,966,000
カナデン	6,700	1,527.000	10,230,900
RYODEN	7,100	2,620.000	18,602,000
岩谷産業	20,400	7,799.000	159,099,600
ナイス	2,600	1,641.000	4,266,600
極東貿易	5,400	2,195.000	11,853,000
アステナホールディングス	18,300	477.000	8,729,100
三愛オブリ	22,200	2,087.000	46,331,400
稲畑産業	16,900	3,175.000	53,657,500
G S Iクレオス	5,000	2,371.000	11,855,000
明和産業	12,500	668.000	8,350,000
ワキタ	16,100	1,569.000	25,260,900
東邦ホールディングス	25,100	3,388.000	85,038,800
サンゲツ	21,200	3,300.000	69,960,000
ミツウロコグループホールディングス	12,800	1,482.000	18,969,600
シナネンホールディングス	2,900	4,885.000	14,166,500
伊藤忠エネクス	21,100	1,572.000	33,169,200
サンリオ	25,400	8,606.000	218,592,400

サンワ テクノス	4,600	2,380.000	10,948,000
リョーサン	6,800	4,970.000	33,796,000
新光商事	12,300	1,199.000	14,747,700
トーホー	4,000	2,902.000	11,608,000
三信電気	3,900	2,244.000	8,751,600
東陽テクニカ	9,100	1,502.000	13,668,200
モスフードサービス	12,600	3,490.000	43,974,000
加賀電子	7,700	6,220.000	47,894,000
ソーダニッカ	8,000	1,269.000	10,152,000
立花エレテック	6,400	3,320.000	21,248,000
フォーバル	1,500	1,259.000	1,888,500
PALTA C	13,100	3,972.000	52,033,200
三谷産業	19,000	411.000	7,809,000
太平洋興発	6,400	851.000	5,446,400
西本Wismettacホールディングス	2,300	5,650.000	12,995,000
KPPグループホールディングス	24,800	718.000	17,806,400
ヤマタネ	4,500	2,834.000	12,753,000
泉州電業	4,500	4,490.000	20,205,000
トラスコ中山	18,200	2,388.000	43,461,600
オートバックスセブン	30,400	1,629.000	49,521,600
モリト	7,100	1,469.000	10,429,900
加藤産業	10,700	4,660.000	49,862,000
イエローハット	15,000	1,904.000	28,560,000
JKホールディングス	7,800	1,075.000	8,385,000
日伝	6,400	2,726.000	17,446,400
杉本商事	4,300	2,241.000	9,636,300
因幡電機産業	21,900	3,460.000	75,774,000
東テク	3,000	8,610.000	25,830,000
ミスミグループ本社	135,500	2,231.500	302,368,250
タキヒヨー	3,200	1,149.000	3,676,800
スズケン	34,300	4,581.000	157,128,300
ジェコス	6,100	1,157.000	7,057,700
ローソン	19,100	10,330.000	197,303,000
サンエー	6,600	4,710.000	31,086,000
カワチ薬品	7,000	2,664.000	18,648,000
エービーシー・マート	39,400	2,896.000	114,102,400
ハードオフコーポレーション	3,300	1,718.000	5,669,400
アスクル	21,600	2,125.000	45,900,000
ゲオホールディングス	10,300	1,930.000	19,879,000
アダストリア	10,900	3,925.000	42,782,500
くら寿司	10,400	4,460.000	46,384,000
キャンドゥ	4,200	2,704.000	11,356,800
パルグループホールディングス	17,500	2,666.000	46,655,000
エディオン	34,700	1,581.000	54,860,700
サーラコーポレーション	18,900	809.000	15,290,100
ハローズ	4,000	4,625.000	18,500,000
フジオフードグループ本社	10,200	1,347.000	13,739,400
あみやき亭	2,400	4,795.000	11,508,000

大黒天物産	2,800	9,730.000	27,244,000
ハニーズホールディングス	7,200	1,723.000	12,405,600
アルペン	7,300	1,988.000	14,512,400
クオールホールディングス	12,400	1,782.000	22,096,800
ジーンズホールディングス	5,600	4,440.000	24,864,000
ピックカメラ	46,400	1,290.000	59,856,000
D C Mホールディングス	49,200	1,500.000	73,800,000
MonotaRO	127,500	1,697.500	216,431,250
DDグループ	2,900	1,239.000	3,593,100
J . フロント リテイリング	104,200	1,580.500	164,688,100
ドトール・日レスホールディングス	15,400	2,083.000	32,078,200
マツキヨココカラ&カンパニー	162,700	2,400.500	390,561,350
ブロンコビリー	5,200	3,595.000	18,694,000
Z O Z O	57,700	3,869.000	223,241,300
トレジャー・ファクトリー	5,000	1,430.000	7,150,000
物語コーポレーション	14,800	4,585.000	67,858,000
三越伊勢丹ホールディングス	150,700	2,270.000	342,089,000
H a m e e	4,900	1,205.000	5,904,500
ウエルシアホールディングス	46,800	2,707.000	126,687,600
クリエイトSDホールディングス	13,500	3,250.000	43,875,000
チムニー	3,500	1,418.000	4,963,000
シュッピン	7,900	1,235.000	9,756,500
オイシックス・ラ・大地	12,300	1,347.000	16,568,100
ネクステージ	20,900	2,767.000	57,830,300
ジョイフル本田	25,000	2,220.000	55,500,000
鳥貴族ホールディングス	3,600	4,435.000	15,966,000
ホットランド	7,100	1,887.000	13,397,700
すかいらくホールディングス	122,200	2,312.000	282,526,400
S F Pホールディングス	4,600	1,927.000	8,864,200
綿半ホールディングス	5,600	1,584.000	8,870,400
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	1,001.000	32,832,800
B E E N O S	4,000	1,946.000	7,784,000
あさひ	7,500	1,320.000	9,900,000
日本調剤	6,400	1,596.000	10,214,400
コスモス薬品	7,700	14,235.000	109,609,500
セブン&アイ・ホールディングス	913,200	2,144.000	1,957,900,800
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	60,100	1,052.000	63,225,200
ツルハホールディングス	18,900	11,565.000	218,578,500
サンマルクホールディングス	7,000	2,214.000	15,498,000
フェリシモ	4,000	925.000	3,700,000
トリドールホールディングス	26,000	4,188.000	108,888,000
T O K Y O B A S E	11,600	343.000	3,978,800
J Mホールディングス	6,900	2,612.000	18,022,800
アレンザホールディングス	6,500	1,035.000	6,727,500
串カツ田中ホールディングス	3,800	1,683.000	6,395,400
クスリのアオキホールディングス	27,300	3,263.000	89,079,900

力の源ホールディングス	4,700	1,572.000	7,388,400
FOOD & LIFE COMPANIES	48,000	3,071.000	147,408,000
メディカルシステムネットワーク	12,000	663.000	7,956,000
ノジマ	26,900	1,662.000	44,707,800
カップ・クリエイト	13,700	1,640.000	22,468,000
良品計画	98,100	2,320.000	227,592,000
アドヴァングループ	10,500	1,224.000	12,852,000
アルビス	2,500	2,700.000	6,750,000
G - 7ホールディングス	9,500	1,435.000	13,632,500
イオン北海道	31,800	901.000	28,651,800
コジマ	15,600	820.000	12,792,000
コーナン商事	11,700	4,315.000	50,485,500
エコス	3,600	2,289.000	8,240,400
ワタミ	10,300	1,000.000	10,300,000
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	180,700	3,815.000	689,370,500
西松屋チェーン	17,600	2,475.000	43,560,000
ゼンショーホールディングス	45,600	6,307.000	287,599,200
幸楽苑ホールディングス	5,000	1,446.000	7,230,000
サイゼリヤ	13,400	5,200.000	69,680,000
V Tホールディングス	33,100	519.000	17,178,900
フジ・コーポレーション	3,800	1,714.000	6,513,200
ユナイテッドアローズ	10,400	1,982.000	20,612,800
ハイデイ日高	13,100	2,598.000	34,033,800
コロワイド	39,700	2,243.500	89,066,950
壱番屋	34,000	1,218.000	41,412,000
スギホールディングス	52,800	2,558.000	135,062,400
薬王堂ホールディングス	4,600	2,710.000	12,466,000
スクロール	13,200	967.000	12,764,400
ヨンドシーホールディングス	7,700	1,895.000	14,591,500
木曽路	12,800	2,712.000	34,713,600
S R Sホールディングス	14,900	1,181.000	17,596,900
リテールパートナーズ	13,000	1,855.000	24,115,000
上新電機	7,600	2,321.000	17,639,600
日本瓦斯	47,500	2,578.500	122,478,750
ロイヤルホールディングス	16,500	2,486.000	41,019,000
いなげや	8,600	1,360.000	11,696,000
チヨダ	9,500	876.000	8,322,000
ライフコーポレーション	9,200	3,890.000	35,788,000
リンガーハット	11,100	2,331.000	25,874,100
MrMaxHD	10,700	611.000	6,537,700
AOKIホールディングス	18,400	1,141.000	20,994,400
オークワ	14,400	850.000	12,240,000
コメリ	13,400	3,640.000	48,776,000
青山商事	19,500	1,791.000	34,924,500
しまむら	21,000	8,963.000	188,223,000
高島屋	63,500	2,328.500	147,859,750

松屋	15,300	991.000	15,162,300
エイチ・ツー・オー リテイリング	40,900	1,946.000	79,591,400
近鉄百貨店	4,900	2,383.000	11,676,700
丸井グループ	60,400	2,434.500	147,043,800
アクシアル リテイリング	5,900	4,140.000	24,426,000
イオン	303,300	3,557.000	1,078,838,100
イズミ	15,900	3,516.000	55,904,400
平和堂	14,800	2,031.000	30,058,800
フジ	13,200	1,884.000	24,868,800
ヤオコー	11,000	9,290.000	102,190,000
ゼビオホールディングス	12,200	990.000	12,078,000
ケーズホールディングス	61,500	1,337.500	82,256,250
Genky DrugStores	3,900	6,620.000	25,818,000
ブックオフグループホールディングス	5,300	1,375.000	7,287,500
ギフトホールディングス	3,900	3,190.000	12,441,000
アインホールディングス	12,600	5,614.000	70,736,400
元気寿司	5,800	3,300.000	19,140,000
ヤマダホールディングス	288,200	446.500	128,681,300
アークランズ	27,100	1,764.000	47,804,400
ニトリホールディングス	32,600	23,215.000	756,809,000
グルメ杵屋	5,900	1,122.000	6,619,800
ケーユーホールディングス	5,900	1,158.000	6,832,200
吉野家ホールディングス	34,000	3,189.000	108,426,000
松屋フーズホールディングス	4,100	5,960.000	24,436,000
サガミホールディングス	13,800	1,584.000	21,859,200
関西フードマーケット	7,700	1,766.000	13,598,200
王将フードサービス	6,000	7,930.000	47,580,000
ミニストップ	6,700	1,539.000	10,311,300
アークス	16,100	3,135.000	50,473,500
パローホールディングス	16,900	2,493.000	42,131,700
ベルク	4,300	6,740.000	28,982,000
大 庄	5,500	1,252.000	6,886,000
ファーストリテイリング	40,200	46,100.000	1,853,220,000
サンドラッグ	30,500	4,839.000	147,589,500
サックスパー ホールディングス	7,700	908.000	6,991,600
やまや	1,000	3,285.000	3,285,000
ベルーナ	21,200	625.000	13,250,000
いよぎんホールディングス	97,900	1,118.000	109,452,200
しずおかフィナンシャルグループ	183,400	1,476.000	270,698,400
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	69,000	1,186.500	81,868,500
楽天銀行	29,300	2,887.000	84,589,100
京都フィナンシャルグループ	104,600	2,753.000	287,963,800
じもとホールディングス	11,000	655.000	7,205,000
めぶきフィナンシャルグループ	408,700	469.600	191,925,520
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10,500	4,655.000	48,877,500
九州フィナンシャルグループ	159,400	1,109.000	176,774,600
ゆうちょ銀行	914,700	1,649.000	1,508,340,300
富山第一銀行	26,300	983.000	25,852,900

コンコルディア・フィナンシャルグループ	443,300	756.900	335,533,770
西日本フィナンシャルホールディングス	49,000	1,917.000	93,933,000
三十三フィナンシャルグループ	7,500	2,075.000	15,562,500
第四北越フィナンシャルグループ	12,600	4,425.000	55,755,000
ひろぎんホールディングス	117,000	1,056.000	123,552,000
おきなわフィナンシャルグループ	6,900	2,634.000	18,174,600
十六フィナンシャルグループ	10,500	4,650.000	48,825,000
北國フィナンシャルホールディングス	8,900	4,870.000	43,343,000
プロクレアホールディングス	10,100	1,897.000	19,159,700
あいちフィナンシャルグループ	12,000	2,639.000	31,668,000
あおぞら銀行	60,200	2,489.000	149,837,800
三菱UFJフィナンシャル・グループ	5,063,600	1,533.500	7,765,030,600
りそなホールディングス	967,000	913.500	883,354,500
三井住友トラスト・ホールディングス	298,600	3,224.000	962,686,400
三井住友フィナンシャルグループ	591,200	8,687.000	5,135,754,400
千葉銀行	229,800	1,226.500	281,849,700
群馬銀行	158,000	829.300	131,029,400
武蔵野銀行	10,200	2,970.000	30,294,000
千葉興業銀行	15,600	1,035.000	16,146,000
筑波銀行	36,200	309.000	11,185,800
七十七銀行	24,900	3,875.000	96,487,500
秋田銀行	4,800	2,140.000	10,272,000
山形銀行	9,100	1,218.000	11,083,800
岩手銀行	5,800	2,629.000	15,248,200
東邦銀行	62,900	352.000	22,140,800
東北銀行	4,600	1,294.000	5,952,400
ふくおかフィナンシャルグループ	72,000	3,996.000	287,712,000
スルガ銀行	73,600	875.000	64,400,000
八十二銀行	173,900	999.000	173,726,100
山梨中央銀行	8,900	1,907.000	16,972,300
大垣共立銀行	15,400	2,267.000	34,911,800
福井銀行	7,500	2,013.000	15,097,500
清水銀行	3,600	1,618.000	5,824,800
滋賀銀行	13,700	4,160.000	56,992,000
南都銀行	12,300	2,854.000	35,104,200
百五銀行	76,000	659.000	50,084,000
紀陽銀行	28,900	1,859.000	53,725,100
ほくほくフィナンシャルグループ	51,400	1,862.000	95,706,800
山陰合同銀行	50,500	1,186.000	59,893,000
鳥取銀行	3,900	1,560.000	6,084,000
百十四銀行	7,900	2,868.000	22,657,200
四国銀行	13,300	1,208.000	16,066,400
阿波銀行	11,500	2,883.000	33,154,500
大分銀行	5,100	2,980.000	15,198,000
宮崎銀行	5,200	2,944.000	15,308,800
佐賀銀行	5,100	2,157.000	11,000,700
琉球銀行	19,200	1,207.000	23,174,400
セブン銀行	267,800	299.300	80,152,540

みずほフィナンシャルグループ	1,122,200	2,966.000	3,328,445,200
高知銀行	2,500	1,053.000	2,632,500
山口フィナンシャルグループ	80,000	1,563.500	125,080,000
名古屋銀行	5,300	6,680.000	35,404,000
北洋銀行	123,000	447.000	54,981,000
大光銀行	5,300	1,565.000	8,294,500
愛媛銀行	11,600	1,125.000	13,050,000
トマト銀行	5,100	1,326.000	6,762,600
京葉銀行	37,400	752.000	28,124,800
栃木銀行	42,100	370.000	15,577,000
北日本銀行	2,600	2,445.000	6,357,000
東和銀行	15,200	732.000	11,126,400
大東銀行	8,500	795.000	6,757,500
トモニホールディングス	81,100	426.000	34,548,600
フィデアホールディングス	8,500	1,640.000	13,940,000
池田泉州ホールディングス	112,400	397.000	44,622,800
F P G	28,100	1,944.000	54,626,400
ジャパンインベストメントアドバイザー	14,600	945.000	13,797,000
S B Iホールディングス	121,600	3,951.000	480,441,600
ジャフコ グループ	26,500	1,807.500	47,898,750
大和証券グループ本社	641,300	1,131.500	725,630,950
野村ホールディングス	1,398,100	941.300	1,316,031,530
岡三証券グループ	73,400	825.000	60,555,000
丸三証券	28,800	1,114.000	32,083,200
東洋証券	27,400	410.000	11,234,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	94,000	616.000	57,904,000
水戸証券	23,800	502.000	11,947,600
いちよし証券	14,800	852.000	12,609,600
松井証券	47,400	860.000	40,764,000
マネックスグループ	83,500	886.000	73,981,000
極東証券	10,900	1,684.000	18,355,600
岩井コスモホールディングス	9,400	2,344.000	22,033,600
アイザワ証券グループ	12,200	1,172.000	14,298,400
スパークス・グループ	9,200	1,917.000	17,636,400
かんぼ生命保険	86,300	2,834.000	244,574,200
F P パートナー	1,700	6,890.000	11,713,000
S O M P Oホールディングス	125,300	9,176.000	1,149,752,800
アニコム ホールディングス	28,500	575.000	16,387,500
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	185,700	7,739.000	1,437,132,300
第一生命ホールディングス	406,000	3,668.000	1,489,208,000
東京海上ホールディングス	821,400	4,576.000	3,758,726,400
T & Dホールディングス	224,200	2,652.000	594,578,400
アドバンスクリエイト	6,300	1,038.000	6,539,400
全国保証	21,600	5,456.000	117,849,600
ジェイリース	4,800	1,258.000	6,038,400
イントラスト	3,900	829.000	3,233,100
日本モーゲージサービス	10,100	537.000	5,423,700

SBIアルヒ	11,000	947.000	10,417,000
プレミアグループ	14,200	2,000.000	28,400,000
クレディセゾン	52,500	3,077.000	161,542,500
芙蓉総合リース	7,400	13,415.000	99,271,000
みずほリース	13,200	5,390.000	71,148,000
東京センチュリー	61,700	1,587.500	97,948,750
日本証券金融	30,900	1,630.000	50,367,000
アイフル	130,200	406.000	52,861,200
リコーリース	7,600	5,380.000	40,888,000
イオンフィナンシャルサービス	47,600	1,360.000	64,736,000
アコム	162,500	392.300	63,748,750
ジャックス	8,600	5,520.000	47,472,000
オリエントコーポレーション	26,800	1,085.000	29,078,000
オリックス	500,100	3,265.000	1,632,826,500
三菱HCキャピタル	365,900	1,041.500	381,084,850
九州リースサービス	4,800	1,420.000	6,816,000
日本取引所グループ	217,200	3,999.000	868,582,800
イー・ギャランティ	13,800	1,879.000	25,930,200
アサックス	2,900	796.000	2,308,400
NECキャピタルソリューション	3,900	3,850.000	15,015,000
Robot Home	32,000	162.000	5,184,000
大東建託	30,500	17,750.000	541,375,000
いちご	100,700	427.000	42,998,900
日本駐車場開発	94,300	198.000	18,671,400
スター・マイカ・ホールディングス	11,000	568.000	6,248,000
SREホールディングス	4,000	3,995.000	15,980,000
ヒューリック	193,100	1,530.000	295,443,000
野村不動産ホールディングス	47,300	3,874.000	183,240,200
三重交通グループホールディングス	19,100	628.000	11,994,800
サムティ	10,100	2,514.000	25,391,400
ディア・ライフ	14,200	943.000	13,390,600
地主	6,800	2,298.000	15,626,400
プレサンスコーポレーション	14,600	1,753.000	25,593,800
JPMC	4,500	1,178.000	5,301,000
フージャースホールディングス	12,200	1,098.000	13,395,600
オープンハウスグループ	30,500	4,699.000	143,319,500
東急不動産ホールディングス	249,000	1,106.000	275,394,000
飯田グループホールディングス	79,800	1,974.000	157,525,200
ムゲンエステート	4,200	1,455.000	6,111,000
シーアールイー	5,300	1,321.000	7,001,300
ケイアイスター不動産	4,200	3,565.000	14,973,000
グッドコムアセット	8,900	723.000	6,434,700
ジェイ・エス・ビー	4,400	2,506.000	11,026,400
ロードスターキャピタル	5,900	2,396.000	14,136,400
霞ヶ関キャピタル	2,300	13,220.000	30,406,000
パーク24	54,500	1,701.500	92,731,750
パラカ	3,200	1,960.000	6,272,000
宮越ホールディングス	4,600	1,353.000	6,223,800

三井不動産	384,300	4,520.000	1,737,036,000
三菱地所	543,400	2,576.500	1,400,070,100
平和不動産	13,900	3,750.000	52,125,000
東京建物	72,700	2,215.000	161,030,500
京阪神ビルディング	15,700	1,542.000	24,209,400
住友不動産	121,000	4,841.000	585,761,000
テオーシー	18,100	676.000	12,235,600
レオパレス21	88,100	497.000	43,785,700
スターツコーポレーション	12,500	3,030.000	37,875,000
フジ住宅	10,800	723.000	7,808,400
空港施設	12,000	608.000	7,296,000
明和地所	6,200	1,093.000	6,776,600
ゴールドクレスト	8,200	2,364.000	19,384,800
エスリード	3,800	3,600.000	13,680,000
日神グループホールディングス	15,200	528.000	8,025,600
日本エスコン	16,700	1,024.000	17,100,800
MIRARTHホールディングス	41,900	488.000	20,447,200
イオンモール	43,200	1,783.500	77,047,200
毎日コムネット	6,300	773.000	4,869,900
カチタス	22,600	1,973.000	44,589,800
トーセイ	14,500	2,216.000	32,132,000
穴吹興産	2,700	2,101.000	5,672,700
サンフロンティア不動産	13,000	1,710.000	22,230,000
FJネクストホールディングス	8,800	1,357.000	11,941,600
日本空港ビルデング	29,600	6,123.000	181,240,800
LIFULL	38,900	174.000	6,768,600
MIXI	19,500	2,695.000	52,552,500
ジェイエイシーリクルートメント	32,000	729.000	23,328,000
日本M&Aセンターホールディングス	141,300	962.900	136,057,770
メンバーズ	4,400	895.000	3,938,000
UTグループ	11,900	3,670.000	43,673,000
アイティメディア	3,600	1,942.000	6,991,200
ケアネット	14,700	685.000	10,069,500
E・Jホールディングス	5,400	1,695.000	9,153,000
オープンアップグループ	26,800	2,094.000	56,119,200
コシダカホールディングス	27,700	944.000	26,148,800
アルトナー	2,000	2,476.000	4,952,000
パソナグループ	11,100	2,845.000	31,579,500
リンクアンドモチベーション	26,700	578.000	15,432,600
エス・エム・エス	31,900	2,556.500	81,552,350
パーソルホールディングス	895,300	211.000	188,908,300
リニカル	9,500	396.000	3,762,000
学情	4,700	1,738.000	8,168,600
スタジオアリス	4,800	2,035.000	9,768,000
NJS	2,000	3,105.000	6,210,000
総合警備保障	150,000	852.000	127,800,000
カカクコム	59,000	1,827.000	107,793,000
アイロムグループ	4,000	1,865.000	7,460,000

セントケア・ホールディング	7,500	903.000	6,772,500
ルネサンス	6,700	1,056.000	7,075,200
ディップ	13,900	2,680.000	37,252,000
デジタルホールディングス	6,000	1,111.000	6,666,000
新日本科学	8,700	1,538.000	13,380,600
エムスリー	172,600	2,080.500	359,094,300
ウェルネット	12,900	555.000	7,159,500
ワールドホールディングス	4,200	2,444.000	10,264,800
ディー・エヌ・エー	33,800	1,490.500	50,378,900
博報堂D Yホールディングス	114,300	1,360.000	155,448,000
ぐるなび	16,000	297.000	4,752,000
タカミヤ	14,000	586.000	8,204,000
ファンコミュニケーションズ	15,000	406.000	6,090,000
ライク	3,800	1,609.000	6,114,200
エスプール	30,200	312.000	9,422,400
WDBホールディングス	4,500	2,275.000	10,237,500
アドウェイズ	14,300	450.000	6,435,000
パリュコマース	8,700	1,058.000	9,204,600
インフォマート	94,600	399.000	37,745,400
J Pホールディングス	27,100	507.000	13,739,700
プレステージ・インターナショナル	43,300	633.000	27,408,900
アミューズ	5,300	1,534.000	8,130,200
ドリームインキュベータ	3,200	2,933.000	9,385,600
クイック	5,900	2,338.000	13,794,200
電通グループ	86,200	4,134.000	356,350,800
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,500	1,111.000	4,999,500
ぴあ	3,100	3,225.000	9,997,500
イオンファンタジー	3,600	2,350.000	8,460,000
シーティーエス	10,600	770.000	8,162,000
H . U . グループホールディングス	27,000	2,553.000	68,931,000
アルプス技研	8,200	2,748.000	22,533,600
日本空調サービス	10,200	884.000	9,016,800
オリエンタルランド	459,700	4,990.000	2,293,903,000
ダスキン	22,000	3,304.000	72,688,000
明光ネットワークジャパン	13,800	704.000	9,715,200
ファルコホールディングス	6,400	2,345.000	15,008,000
ラウンドワン	83,400	824.000	68,721,600
リゾートトラスト	39,000	2,557.000	99,723,000
ビー・エム・エル	11,500	2,965.000	34,097,500
リソー教育	50,300	222.000	11,166,600
早稲田アカデミー	5,500	1,655.000	9,102,500
ユー・エス・エス	98,600	2,667.500	263,015,500
東京個別指導学院	20,000	428.000	8,560,000
サイバーエージェント	196,000	1,063.000	208,348,000
楽天グループ	748,300	827.200	618,993,760
クリーク・アンド・リバー社	5,100	1,926.000	9,822,600
SBIグローバルアセットマネジメント	18,000	753.000	13,554,000
テー・オー・ダブリュー	33,800	369.000	12,472,200

山田コンサルティンググループ	4,300	1,749.000	7,520,700
セントラルスポーツ	3,700	2,524.000	9,338,800
フルキャストホールディングス	8,800	1,483.000	13,050,400
エン・ジャパン	15,200	2,676.000	40,675,200
テクノプロ・ホールディングス	52,000	3,012.000	156,624,000
アイ・アールジャパンホールディングス	5,400	1,368.000	7,387,200
K e e P e r 技研	5,600	5,230.000	29,288,000
G u n o s y	9,200	863.000	7,939,600
イー・ガーディアン	4,300	1,362.000	5,856,600
ジャパンマテリアル	27,200	2,441.000	66,395,200
ベクトル	11,700	1,145.000	13,396,500
チャーム・ケア・コーポレーション	7,900	1,472.000	11,628,800
キャリアリンク	3,600	2,664.000	9,590,400
I B J	8,600	559.000	4,807,400
アサンテ	5,200	1,711.000	8,897,200
バリューHR	8,000	1,335.000	10,680,000
M&Aキャピタルパートナーズ	7,700	2,366.000	18,218,200
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,200	1,135.000	8,172,000
E R Iホールディングス	2,700	1,775.000	4,792,500
シグマクス・ホールディングス	12,300	1,741.000	21,414,300
ウィルグループ	7,000	1,105.000	7,735,000
メドピア	9,400	727.000	6,833,800
レアジョブ	4,000	820.000	3,280,000
リクルートホールディングス	643,100	6,519.000	4,192,368,900
エラン	12,000	924.000	11,088,000
日本郵政	1,023,300	1,509.000	1,544,159,700
ベルシステム24ホールディングス	11,300	1,551.000	17,526,300
鎌倉新書	9,900	780.000	7,722,000
エアトリ	7,200	1,585.000	11,412,000
アトラエ	7,800	435.000	3,393,000
ストライク	3,900	4,830.000	18,837,000
ソラスト	25,400	538.000	13,665,200
セラク	5,300	1,107.000	5,867,100
インソース	20,100	858.000	17,245,800
ベйкаレント・コンサルティング	64,500	3,024.000	195,048,000
O r c h e s t r a H o l d i n g s	2,700	984.000	2,656,800
アイモバイル	14,100	399.000	5,625,900
M S - J a p a n	4,000	1,184.000	4,736,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	28,800	2,447.000	70,473,600
グリーンズ	2,300	2,373.000	5,457,900
エル・ティー・エス	1,300	2,392.000	3,109,600
ミダックホールディングス	5,700	1,565.000	8,920,500
キュービーネットホールディングス	5,900	1,220.000	7,198,000
R P Aホールディングス	17,300	271.000	4,688,300
マネジメントソリューションズ	4,000	2,316.000	9,264,000
フロンティア・マネジメント	2,600	1,625.000	4,225,000
コプロ・ホールディングス	1,600	1,793.000	2,868,800

アンビスホールディングス	9,700	2,438.000	23,648,600
カーブスホールディングス	24,400	817.000	19,934,800
フォーラムエンジニアリング	13,000	1,000.000	13,000,000
FAST FITNESS JAPAN	4,100	1,082.000	4,436,200
ダイレクトマーケティングミックス	13,800	309.000	4,264,200
ポピズ	3,500	1,392.000	4,872,000
LITALICO	7,200	2,141.000	15,415,200
リログループ	45,700	1,221.000	55,799,700
東祥	10,900	782.000	8,523,800
ID&E ホールディングス	5,600	4,075.000	22,820,000
ビーウィズ	2,400	2,112.000	5,068,800
TREホールディングス	17,900	1,223.000	21,891,700
人・夢・技術グループ	3,600	1,715.000	6,174,000
NISSOホールディングス	9,000	882.000	7,938,000
大栄環境	16,400	2,684.000	44,017,600
日本管財ホールディングス	8,900	2,594.000	23,086,600
M&A総研ホールディングス	4,300	6,180.000	26,574,000
エイチ・アイ・エス	26,600	2,018.000	53,678,800
ラックランド	4,100	2,250.000	9,225,000
共立メンテナンス	14,300	6,704.000	95,867,200
イチネンホールディングス	9,100	1,714.000	15,597,400
建設技術研究所	4,600	5,470.000	25,162,000
スペース	7,100	1,026.000	7,284,600
燦ホールディングス	8,500	1,039.000	8,831,500
スバル興業	4,000	2,705.000	10,820,000
東京テアトル	8,500	1,145.000	9,732,500
ナガワ	2,900	7,610.000	22,069,000
東京都競馬	7,600	4,405.000	33,478,000
カナモト	14,400	2,643.000	38,059,200
ニシオホールディングス	8,300	3,845.000	31,913,500
トランス・コスモス	11,300	3,180.000	35,934,000
乃村工藝社	40,100	914.000	36,651,400
藤田観光	3,800	7,260.000	27,588,000
KNT-CTホールディングス	6,100	1,350.000	8,235,000
トーカイ	7,600	2,187.000	16,621,200
白洋舎	1,300	2,753.000	3,578,900
セコム	88,600	11,350.000	1,005,610,000
セントラル警備保障	5,000	2,587.000	12,935,000
丹青社	18,200	877.000	15,961,400
メイテックグループホールディングス	32,500	2,996.000	97,370,000
応用地質	8,700	2,256.000	19,627,200
船井総研ホールディングス	18,500	2,483.000	45,935,500
いであ	3,200	2,312.000	7,398,400
学究社	4,200	2,084.000	8,752,800
イオンディライト	9,700	3,505.000	33,998,500
ダイセキ	18,100	3,810.000	68,961,000
ステップ	3,200	2,001.000	6,403,200
合計	130,065,900		325,728,271,580

(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3月18日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	7,348,983,304
金銭信託	17,676,373
コール・ローン	659,478,105
株式	697,905,278,088
投資証券	14,144,418,355
派生商品評価勘定	6,836,243
未収入金	5,973,513
未収配当金	1,225,925,215
差入委託証拠金	2,627,932,387
流動資産合計	723,942,501,583
資産合計	
723,942,501,583	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	103,987,879
未払解約金	431,809,516
その他未払費用	2,299
流動負債合計	535,799,694
負債合計	
535,799,694	
純資産の部	
元本等	
元本	84,869,986,453
剰余金	
剰余金又は欠損金 ()	638,536,715,436
元本等合計	723,406,701,889
純資産合計	
723,406,701,889	
負債純資産合計	
723,942,501,583	

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2023年3月24日
	至 2024年3月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	(2024年3月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	84,869,986,453口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 8.5237円 (1万口当たりの純資産額85,237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3月24日 至 2024年3月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、投資証券を組み入れております。</p>

	<p>2) デリバティブ取引</p> <p>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、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3月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（株式、投資証券）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(2024年3月18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 JUN24	9,774,162,429	-	9,673,602,875	100,559,554
	SPI 200 FUTURES MAR24	318,550,541	-	319,375,770	825,229
	FTSE 100 IDX FUT JUN24	503,324,494	-	501,638,992	1,685,502
	EURO STOXX 50 JUN24	1,810,826,608	-	1,812,563,775	1,737,167
	小計	12,406,864,072	-	12,307,181,412	99,682,660
	合計	12,406,864,072	-	12,307,181,412	99,682,660

(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		
為替予約取引 買建	アメリカ・ドル	1,175,112,706	-	1,178,275,505	3,162,799
	カナダ・ドル	38,675,005	-	38,675,566	561
	イギリス・ポンド	53,014,045	-	53,014,240	195
	スイス・フラン	41,998,750	-	42,245,250	246,500
	デンマーク・クローネ	36,960,758	-	36,957,536	3,222
	ネ				

市場取引以 外の取引	スウェーデン・ク ローナ	45,888,115	-	45,897,044	8,929
	ユーロ	114,069,243	-	114,076,825	7,582
	小計	1,505,718,622	-	1,509,141,966	3,423,344
	売建				
	アメリカ・ドル	164,229,940	-	165,122,260	892,320
	小計	164,229,940	-	165,122,260	892,320
合 計		1,669,948,562	-	1,674,264,226	2,531,024

(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あります。

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あります。

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あります。

- ・ 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あります。

- 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あります。

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3月24日 至 2024年3月18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3月18日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	75,417,894,105円
同期中における追加設定元本額	17,029,657,400円
同期中における一部解約元本額	7,577,565,052円
2024年3月18日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	42,658,516,512円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	262,118,456円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,015,861,713円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	791,306,096円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	41,379,821円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	765,630円

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	3,838,847円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	13,730,815円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	43,252,923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)	51,957,615円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	109,264,367円
外国株式指数ファンド	1,085,629,786円
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	22,684,512,889円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	101,416,244円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	138,999,947円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	81,524,499円
イオン・バランス戦略ファンド	42,414,706円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	27,902,795円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	137,175,352円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	131,574,054円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	518,522,738円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	320,924,844円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	446,608,982円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	63,162,793円
三井住友D S・外国株式インデックス年金ファンド	2,634,399,749円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	10,845,711円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	57,321,934円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	58,610,821円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	2,899,641円
S M B C・DCインデックスファンド(M S C Iコクサイ)	1,438,539,807円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	181,710,303円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	2,981,972,149円
三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド	139,908,241円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	3,189,068円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	1,998,744円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	2,834,012円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	910,620円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	529,335円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	140,744円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	2,481,010円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	13,468,456円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	9,441,829円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	3,980,305円
S M A M・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	290,204,336円
バランスファンドV A(安定運用型) <適格機関投資家限定>	2,542,922円
S M A M・バランスファンドV A安定成長型 <適格機関投資家限定>	11,708,833円
S M A M・バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	300,183,498円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	514,974,307円
S M A M・バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	2,311,844,315円
S M A M・バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	8,008,470円
S M A M・バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定>	37,259,371円
S M A M・バランスファンドV A 7 5 <適格機関投資家専用>	366,150,876円
S M A M・バランスファンドV L 国際分散型 <適格機関投資家限定>	25,858,474円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5 <適格機関投資家専用>	64,805,042円

SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	327,255,500円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	213,560,282円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	472,266,549円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	175,977,154円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	40,990,345円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	4,833,474円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	5,585,430円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	3,245,145円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	11,068,487円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	36,517,528円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	79,246,515円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	31,231,025円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	131,008,184円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	48,871,271円
SMAM・外国株式インデックスファンドSA<適格機関投資家限定>	802,311,788円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	23,417,421円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	12,599,665円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	20,272,952円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	136,627,922円
SMDAM・年金Wリスクコントロールファンド(リスク3%)<適格機関投資家限定>	42,014,469円
合 計	84,869,986,453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	32.000	883,456.00	
	BAKER HUGHES CO	78,082	32.320	2,523,610.24	
	CHENIERE ENERGY INC	19,829	161.290	3,198,219.41	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	7,695	83.470	642,301.65	
	CHEVRON CORP	143,891	155.550	22,382,245.05	
	CONOCOPHILLIPS	95,633	120.040	11,479,785.32	
	COTERRA ENERGY INC	59,741	26.420	1,578,357.22	
	DEVON ENERGY CORP	49,897	47.620	2,376,095.14	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	13,065	189.940	2,481,566.10	
	EOG RESOURCES INC	47,111	122.790	5,784,759.69	
	EQT CORP	33,522	33.430	1,120,640.46	
	EXXON MOBIL CORP	319,361	111.270	35,535,298.47	
	HALLIBURTON CO	67,581	37.730	2,549,831.13	
	HESS CORP	21,198	150.860	3,197,930.28	
HF SINCLAIR CORP	10,663	59.340	632,742.42		

KINDER MORGAN INC	156,197	17.600	2,749,067.20	
MARATHON OIL CORP	42,380	26.510	1,123,493.80	
MARATHON PETROLEUM CORP	31,150	193.840	6,038,116.00	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	51,961	62.650	3,255,356.65	
ONEOK INC	47,832	77.000	3,683,064.00	
OVINTIV INC	23,075	50.460	1,164,364.50	
PHILLIPS 66	36,059	159.030	5,734,462.77	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	18,987	249.960	4,745,990.52	
SCHLUMBERGER LTD	114,141	52.870	6,034,634.67	
TARGA RESOURCES CORP	15,416	105.970	1,633,633.52	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	417	1,666.490	694,926.33	
VALERO ENERGY CORP	26,805	163.700	4,387,978.50	
WILLIAMS COS INC	97,204	37.000	3,596,548.00	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	18,025	244.630	4,409,455.75	
ALBEMARLE CORP	8,338	122.140	1,018,403.32	
AMCOR PLC	122,899	9.480	1,165,082.52	
AVERY DENNISON CORP	6,759	215.680	1,457,781.12	
BALL CORP	23,469	64.080	1,503,893.52	
CELANESE CORP	8,742	160.050	1,399,157.10	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	14,020	83.420	1,169,548.40	
CLEVELAND-CLIFFS INC	47,180	19.760	932,276.80	
CORTEVA INC	53,900	55.090	2,969,351.00	
CROWN HOLDINGS INC	9,413	77.720	731,578.36	
DOW INC	53,862	57.040	3,072,288.48	
DUPONT DE NEMOURS INC	36,397	73.430	2,672,631.71	
EASTMAN CHEMICAL CO	9,517	92.300	878,419.10	
ECOLAB INC	20,862	226.700	4,729,415.40	
FMC CORP	8,548	65.050	556,047.40	
FREEMONT-MCMORAN INC	113,312	44.610	5,054,848.32	
INTERNATIONAL PAPER CO	23,472	36.350	853,207.20	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	20,983	82.850	1,738,441.55	
LINDE PLC	38,572	468.230	18,060,567.56	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	22,165	99.910	2,214,505.15	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,759	596.270	2,837,648.93	
MOSAIC CO/THE	25,489	32.100	818,196.90	
NEWMONT CORP	94,978	33.880	3,217,854.64	
NUCOR CORP	18,997	188.480	3,580,554.56	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,111	182.910	1,300,673.01	
PPG INDUSTRIES INC	18,754	137.860	2,585,426.44	
RELIANCE INC	5,040	320.640	1,616,025.60	
RPM INTERNATIONAL INC	10,397	115.690	1,202,828.93	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	19,206	334.660	6,427,479.96	
STEEL DYNAMICS INC	12,713	137.900	1,753,122.70	
VULCAN MATERIALS CO	11,015	266.860	2,939,462.90	

WESTLAKE CORP	2,189	146.790	321,323.31	
WESTROCK CO	23,379	48.600	1,136,219.40	
3M CO	42,482	105.000	4,460,610.00	
AECOM	10,261	91.580	939,702.38	
AERCAP HOLDINGS NV	17,564	85.830	1,507,518.12	
ALLEGION PLC	6,843	130.390	892,258.77	
AMETEK INC	18,518	181.520	3,361,387.36	
AXON ENTERPRISE INC	5,927	307.650	1,823,441.55	
BOEING CO/THE	45,164	182.530	8,243,784.92	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	9,801	195.490	1,915,997.49	
CARLISLE COS INC	3,499	371.480	1,299,808.52	
CARRIER GLOBAL CORP	66,639	57.050	3,801,754.95	
CATERPILLAR INC	40,207	346.970	13,950,622.79	
CNH INDUSTRIAL NV	87,561	12.340	1,080,502.74	
CUMMINS INC	11,429	274.840	3,141,146.36	
DEERE & CO	21,624	383.390	8,290,425.36	
DOVER CORP	10,436	175.530	1,831,831.08	
EATON CORP PLC	31,946	297.900	9,516,713.40	
EMERSON ELECTRIC CO	45,278	110.590	5,007,294.02	
FASTENAL CO	47,002	75.030	3,526,560.06	
FERGUSON PLC	16,077	207.530	3,336,459.81	
FORTIVE CORP	29,388	85.350	2,508,265.80	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	10,648	80.110	853,011.28	
GENERAL DYNAMICS CORP	19,052	275.210	5,243,300.92	
GENERAL ELECTRIC CO	87,887	168.890	14,843,235.43	
GRACO INC	15,068	93.440	1,407,953.92	
HEICO CORP	3,085	187.190	577,481.15	
HEICO CORP-CLASS A	6,593	150.300	990,927.90	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	52,330	197.690	10,345,117.70	
HOWMET AEROSPACE INC	33,070	66.240	2,190,556.80	
HUBBELL INC	3,897	395.150	1,539,899.55	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,888	289.020	834,689.76	
IDEX CORP	6,048	239.970	1,451,338.56	
ILLINOIS TOOL WORKS	24,584	266.920	6,561,961.28	
INGERSOLL-RAND INC	33,421	90.470	3,023,597.87	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	11,600	39.790	461,564.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	52,470	63.190	3,315,579.30	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	15,814	212.860	3,366,168.04	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,750	472.080	1,298,220.00	
LOCKHEED MARTIN CORP	17,925	435.820	7,812,073.50	
MASCO CORP	19,187	74.160	1,422,907.92	
NORDSON CORP	3,927	263.200	1,033,586.40	
NORTHROP GRUMMAN CORP	11,636	461.750	5,372,923.00	
OTIS WORLDWIDE CORP	31,838	98.500	3,136,043.00	

OWENS CORNING	7,597	159.790	1,213,924.63	
PACCAR INC	43,068	118.330	5,096,236.44	
PARKER HANNIFIN CORP	10,389	535.420	5,562,478.38	
PENTAIR PLC	11,509	80.630	927,970.67	
QUANTA SERVICES INC	11,797	242.750	2,863,721.75	
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,678	280.880	2,437,476.64	
RTX CORP	114,716	92.930	10,660,557.88	
SMITH (A.O.) CORP	10,652	87.090	927,682.68	
SNAP-ON INC	4,041	289.200	1,168,657.20	
STANLEY BLACK & DECKER INC	10,869	88.150	958,102.35	
TEXTRON INC	14,870	92.910	1,381,571.70	
TORO CO	8,097	89.710	726,381.87	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	18,510	291.410	5,393,999.10	
TRANSDIGM GROUP INC	4,470	1,172.200	5,239,734.00	
UNITED RENTALS INC	5,383	675.580	3,636,647.14	
VERTIV HOLDINGS CO-A	28,880	74.160	2,141,740.80	
WABTEC CORP	15,150	139.820	2,118,273.00	
WATSCO INC	2,364	404.200	955,528.80	
WW GRAINGER INC	3,504	994.370	3,484,272.48	
XYLEM INC	19,463	127.270	2,477,056.01	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	33,429	242.090	8,092,826.61	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	10,637	144.790	1,540,131.23	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	8,963	200.200	1,794,392.60	
CINTAS CORP	7,515	627.380	4,714,760.70	
COPART INC	67,779	56.130	3,804,435.27	
DAYFORCE INC	10,485	66.090	692,953.65	
EQUIFAX INC	10,373	252.940	2,623,746.62	
JACOBS SOLUTIONS INC	10,393	148.970	1,548,245.21	
LEIDOS HOLDINGS INC	11,403	127.920	1,458,671.76	
PAYCHEX INC	24,917	120.280	2,997,016.76	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,778	189.700	716,686.60	
PAYLOCITY HOLDING CORP	2,718	166.580	452,764.44	
REPUBLIC SERVICES INC	17,805	186.310	3,317,249.55	
ROBERT HALF INC	8,149	78.850	642,548.65	
ROLLINS INC	25,137	46.350	1,165,099.95	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	19,314	62.020	1,197,854.28	
TRANSUNION	14,503	76.950	1,116,005.85	
VERALTO CORP	17,640	86.500	1,525,860.00	
VERISK ANALYTICS INC	11,354	234.520	2,662,740.08	
WASTE CONNECTIONS INC	20,167	170.930	3,447,145.31	
WASTE MANAGEMENT INC	31,845	210.530	6,704,327.85	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,726	73.940	645,200.44	
CSX CORP	154,835	36.970	5,724,249.95	
DELTA AIR LINES INC	14,192	43.120	611,959.04	

EXPEDITORS INTL WASH INC	10,436	119.860	1,250,858.96	
FEDEX CORP	19,408	253.290	4,915,852.32	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	159,485	3.170	505,567.45	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	6,308	193.920	1,223,247.36	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	12,089	54.140	654,498.46	
NORFOLK SOUTHERN CORP	18,442	255.830	4,718,016.86	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	7,677	421.110	3,232,861.47	
SOUTHWEST AIRLINES CO	14,057	28.350	398,515.95	
UBER TECHNOLOGIES INC	149,788	76.070	11,394,373.16	
U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING	5,850	64.850	379,372.50	
UNION PACIFIC CORP	48,339	244.130	11,801,000.07	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	57,939	153.370	8,886,104.43	
APTIV PLC	21,117	77.240	1,631,077.08	
BORGWARNER INC	17,433	32.120	559,947.96	
FORD MOTOR CO	325,996	12.060	3,931,511.76	
GENERAL MOTORS CO	112,023	40.690	4,558,215.87	
LEAR CORP	3,736	140.180	523,712.48	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	45,698	11.040	504,505.92	
TESLA INC	228,609	163.570	37,393,574.13	
DECKERS OUTDOOR CORP	2,220	909.800	2,019,756.00	
DR HORTON INC	24,030	151.690	3,645,110.70	
GARMIN LTD	13,282	145.750	1,935,851.50	
HASBRO INC	11,407	53.310	608,107.17	
LENNAR CORP-A	19,331	156.570	3,026,654.67	
LULULEMON ATHLETICA INC	9,037	464.940	4,201,662.78	
NIKE INC -CL B	97,809	99.640	9,745,688.76	
NVR INC	250	7,565.870	1,891,467.50	
PULTEGROUP INC	17,535	110.900	1,944,631.50	
AIRBNB INC-CLASS A	35,805	160.640	5,751,715.20	
BOOKING HOLDINGS INC	2,816	3,413.980	9,613,767.68	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	15,881	39.170	622,058.77	
CARNIVAL CORP	84,815	16.260	1,379,091.90	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,228	2,756.390	6,141,236.92	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,323	171.960	1,603,183.08	
DOMINO'S PIZZA INC	2,875	441.220	1,268,507.50	
DOORDASH INC - A	20,142	130.550	2,629,538.10	
DRAFTKINGS INC-CL A	32,265	41.780	1,348,031.70	
EXPEDIA GROUP INC	10,081	133.470	1,345,511.07	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	20,092	204.660	4,112,028.72	
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,371	153.600	517,785.60	
LAS VEGAS SANDS CORP	27,977	51.030	1,427,666.31	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	19,665	244.070	4,799,636.55	
MCDONALD'S CORP	57,912	279.140	16,165,555.68	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,198	42.880	951,850.24	

ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	19,234	128.920	2,479,647.28	
STARBUCKS CORP	91,761	90.120	8,269,501.32	
VAIL RESORTS INC	2,860	218.720	625,539.20	
WYNN RESORTS LTD	7,730	99.090	765,965.70	
YUM! BRANDS INC	22,535	136.840	3,083,689.40	
AMAZON.COM INC	743,977	174.420	129,764,468.34	
AUTOZONE INC	1,423	3,124.330	4,445,921.59	
BATH & BODY WORKS INC	15,400	45.630	702,702.00	
BEST BUY CO INC	14,954	78.020	1,166,711.08	
BURLINGTON STORES INC	4,802	218.030	1,046,980.06	
CARMAX INC	14,212	80.740	1,147,476.88	
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,406	211.480	931,780.88	
EBAY INC	40,534	52.200	2,115,874.80	
ETSY INC	9,090	66.260	602,303.40	
GENUINE PARTS CO	10,245	153.660	1,574,246.70	
GLOBAL-E ONLINE LTD	5,491	33.315	182,932.66	
HOME DEPOT INC	79,203	373.230	29,560,935.69	
LKQ CORP	18,982	51.510	977,762.82	
LOWE'S COS INC	46,096	244.730	11,281,074.08	
MERCADOLIBRE INC	3,632	1,499.510	5,446,220.32	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,881	1,113.180	5,433,431.58	
POOL CORP	3,252	399.310	1,298,556.12	
ROSS STORES INC	26,967	145.120	3,913,451.04	
TJX COMPANIES INC	91,584	97.550	8,934,019.20	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,071	257.150	2,075,457.65	
ULTA BEAUTY INC	3,734	535.980	2,001,349.32	
WILLIAMS-SONOMA INC	5,476	283.770	1,553,924.52	
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	31,907	20.800	663,665.60	
COSTCO WHOLESALE CORP	35,569	725.630	25,809,933.47	
DOLLAR GENERAL CORP	18,277	151.950	2,777,190.15	
DOLLAR TREE INC	15,923	127.420	2,028,908.66	
KROGER CO	56,767	56.060	3,182,358.02	
SYSCO CORP	39,957	80.920	3,233,320.44	
TARGET CORP	36,380	164.220	5,974,323.60	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	52,808	20.820	1,099,462.56	
WALMART INC	352,461	60.680	21,387,333.48	
ALTRIA GROUP INC	143,314	43.870	6,287,185.18	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	42,289	59.310	2,508,160.59	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	22,643	53.720	1,216,381.96	
BUNGE GLOBAL SA	12,343	95.560	1,179,497.08	
CAMPBELL SOUP CO	12,945	42.710	552,880.95	
CELSIUS HOLDINGS INC	11,375	92.900	1,056,737.50	
COCA-COLA CO/THE	326,114	59.880	19,527,706.32	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	18,105	70.920	1,284,006.60	

CONAGRA BRANDS INC	39,722	28.070	1,114,996.54	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,701	267.640	3,399,295.64	
DARLING INGREDIENTS INC	10,514	44.440	467,242.16	
GENERAL MILLS INC	46,029	66.760	3,072,896.04	
HERSHEY CO/THE	12,733	193.540	2,464,344.82	
HORMEL FOODS CORP	25,536	34.140	871,799.04	
JM SMUCKER CO/THE	8,172	122.070	997,556.04	
KELLANOVA	19,503	53.560	1,044,580.68	
KEURIG DR PEPPER INC	80,434	28.880	2,322,933.92	
KRAFT HEINZ CO/THE	71,746	34.370	2,465,910.02	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	10,534	102.060	1,075,100.04	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,425	68.170	1,256,032.25	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	16,433	67.470	1,108,734.51	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	110,679	70.750	7,830,539.25	
MONSTER BEVERAGE CORP	60,052	60.450	3,630,143.40	
PEPSICO INC	109,192	164.660	17,979,554.72	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	125,615	94.270	11,841,726.05	
TYSON FOODS INC-CL A	25,497	56.150	1,431,656.55	
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,954	104.340	2,082,000.36	
CLOROX COMPANY	9,104	150.160	1,367,056.64	
COLGATE-PALMOLIVE CO	63,558	88.450	5,621,705.10	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	19,241	149.750	2,881,339.75	
KENVUE INC	136,817	20.340	2,782,857.78	
KIMBERLY-CLARK CORP	28,172	124.470	3,506,568.84	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	189,216	161.380	30,535,678.08	
ABBOTT LABORATORIES	137,987	115.490	15,936,118.63	
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,703	314.350	1,792,738.05	
BAXTER INTERNATIONAL INC	39,241	41.610	1,632,818.01	
BECTON DICKINSON AND CO	22,525	236.710	5,331,892.75	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	119,191	66.230	7,894,019.93	
CARDINAL HEALTH INC	20,986	110.610	2,321,261.46	
CENCORA INC	13,560	238.230	3,230,398.80	
CENTENE CORP	44,436	75.470	3,353,584.92	
COOPER COS INC/THE	17,340	100.710	1,746,311.40	
CVS HEALTH CORP	104,686	77.400	8,102,696.40	
DAVITA INC	4,138	136.650	565,457.70	
DEXCOM INC	30,245	130.460	3,945,762.70	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	47,943	92.310	4,425,618.33	
ELEVANCE HEALTH INC	18,843	513.080	9,667,966.44	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	31,160	89.410	2,786,015.60	
HCA HEALTHCARE INC	16,132	321.970	5,194,020.04	
HENRY SCHEIN INC	10,457	74.580	779,883.06	
HOLOGIC INC	19,730	75.910	1,497,704.30	
HUMANA INC	9,498	348.150	3,306,728.70	

IDEXX LABORATORIES INC	6,610	529.770	3,501,779.70	
INSULET CORP	5,082	165.860	842,900.52	
INTUITIVE SURGICAL INC	28,058	396.280	11,118,824.24	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	6,245	209.210	1,306,516.45	
MCKESSON CORP	10,903	533.640	5,818,276.92	
MEDTRONIC PLC	106,507	83.570	8,900,789.99	
MOLINA HEALTHCARE INC	4,673	404.450	1,889,994.85	
QUEST DIAGNOSTICS INC	9,647	128.280	1,237,517.16	
RESMED INC	12,536	190.050	2,382,466.80	
STERIS PLC	7,525	230.050	1,731,126.25	
STRYKER CORP	27,336	352.230	9,628,559.28	
TELEFLEX INC	3,067	215.390	660,601.13	
THE CIGNA GROUP	23,734	352.050	8,355,554.70	
UNITEDHEALTH GROUP INC	74,182	490.820	36,410,009.24	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,203	173.900	730,901.70	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12,279	226.980	2,787,087.42	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,537	125.170	1,944,766.29	
ABBVIE INC	141,866	177.880	25,235,124.08	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	23,121	147.480	3,409,885.08	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,171	149.270	1,368,955.17	
AMGEN INC	42,647	268.870	11,466,498.89	
AVANTOR INC	56,039	25.080	1,405,458.12	
BIOGEN INC	11,114	219.310	2,437,411.34	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	13,832	83.870	1,160,089.84	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,728	333.510	576,305.28	
BIO-TECHNE CORP	13,296	72.520	964,225.92	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	165,115	52.340	8,642,119.10	
CATALENT INC	16,025	56.220	900,925.50	
CHARLES RIVER LABORATORIES	3,467	258.970	897,848.99	
DANAHER CORP	55,838	249.400	13,925,997.20	
ELI LILLY & CO	64,661	754.170	48,765,386.37	
EXACT SCIENCES CORP	13,570	57.710	783,124.70	
GILEAD SCIENCES INC	101,504	73.690	7,479,829.76	
ILLUMINA INC	11,573	127.730	1,478,219.29	
INCYTE CORP	15,899	58.370	928,024.63	
IQVIA HOLDINGS INC	14,439	252.710	3,648,879.69	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,089	120.900	494,360.10	
JOHNSON & JOHNSON	193,233	158.180	30,565,595.94	
MERCK & CO. INC.	203,578	121.520	24,738,798.56	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,691	1,324.450	2,239,644.95	
MODERNA INC	27,369	103.850	2,842,270.65	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,744	139.100	1,216,290.40	
PFIZER INC	450,002	27.940	12,573,055.88	
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,559	964.470	8,254,898.73	

REPLIGEN CORP	3,456	189.930	656,398.08	
REVVITY INC	10,411	104.900	1,092,113.90	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	27,162	30.090	817,304.58	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	92,472	13.430	1,241,898.96	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	30,671	584.150	17,916,464.65	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,537	235.780	833,953.86	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,919	407.690	8,528,467.11	
VIATRIS INC	83,466	11.940	996,584.04	
WATERS CORP	5,084	352.900	1,794,143.60	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	6,204	387.620	2,404,794.48	
ZOETIS INC	36,026	172.570	6,217,006.82	
BANK OF AMERICA CORP	567,727	35.410	20,103,213.07	
CITIGROUP INC	150,445	57.610	8,667,136.45	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	36,122	33.490	1,209,725.78	
FIFTH THIRD BANCORP	58,586	35.240	2,064,570.64	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	845	1,542.900	1,303,750.50	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	105,007	13.050	1,370,341.35	
JPMORGAN CHASE & CO	231,777	190.300	44,107,163.10	
KEYCORP	84,828	14.480	1,228,309.44	
M & T BANK CORP	12,629	140.530	1,774,753.37	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	32,800	148.780	4,879,984.00	
REGIONS FINANCIAL CORP	79,089	19.050	1,506,645.45	
TRUIST FINANCIAL CORP	110,627	34.860	3,856,457.22	
US BANCORP	124,161	42.080	5,224,694.88	
WELLS FARGO & CO	291,035	57.510	16,737,422.85	
ALLY FINANCIAL INC	20,139	37.620	757,629.18	
AMERICAN EXPRESS CO	47,234	218.460	10,318,739.64	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,978	419.490	3,346,691.22	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	31,181	110.410	3,442,694.21	
ARES MANAGEMENT CORP - A	13,891	132.110	1,835,140.01	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	61,100	54.410	3,324,451.00	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	105,086	408.130	42,888,749.18	
BLACKROCK INC	11,942	802.520	9,583,693.84	
BLACKSTONE INC	57,022	124.970	7,126,039.34	
BLOCK INC	43,616	80.170	3,496,694.72	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	29,775	135.550	4,036,001.25	
CARLYLE GROUP INC/THE	16,730	44.580	745,823.40	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9,059	183.520	1,662,507.68	
CME GROUP INC	28,301	217.500	6,155,467.50	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	13,634	242.360	3,304,336.24	
COREBRIDGE FINANCIAL INC	19,925	25.410	506,294.25	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	18,645	120.240	2,241,874.80	
EQUITABLE HOLDINGS INC	22,820	35.220	803,720.40	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,946	475.960	1,402,178.16	

FIDELITY NATIONAL INFO SERV	47,604	69.120	3,290,388.48	
FISERV INC	46,955	149.630	7,025,876.65	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,278	295.640	1,856,027.92	
FRANKLIN RESOURCES INC	21,778	26.900	585,828.20	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	6,533	54.250	354,415.25	
GLOBAL PAYMENTS INC	20,594	129.880	2,674,748.72	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	26,343	387.210	10,200,273.03	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	46,756	134.640	6,295,227.84	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,971	170.950	849,792.45	
KKR & CO INC	45,385	96.700	4,388,729.50	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	6,164	268.440	1,654,664.16	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,653	218.450	579,547.85	
MASTERCARD INC - A	66,608	475.830	31,694,084.64	
MOODY'S CORP	13,390	384.160	5,143,902.40	
MORGAN STANLEY	96,914	88.380	8,565,259.32	
MSCI INC	6,223	544.740	3,389,917.02	
NASDAQ INC	27,999	59.680	1,670,980.32	
NORTHERN TRUST CORP	16,793	81.460	1,367,957.78	
PAYPAL HOLDINGS INC	80,330	62.850	5,048,740.50	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	17,112	120.760	2,066,445.12	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	31,965	18.150	580,164.75	
S&P GLOBAL INC	25,973	422.810	10,981,644.13	
SCHWAB (CHARLES) CORP	122,498	67.040	8,212,265.92	
SEI INVESTMENTS COMPANY	7,550	68.630	518,156.50	
STATE STREET CORP	25,474	72.500	1,846,865.00	
SYNCHRONY FINANCIAL	32,112	41.780	1,341,639.36	
T ROWE PRICE GROUP INC	17,303	114.860	1,987,422.58	
TOAST INC-CLASS A	21,393	23.550	503,805.15	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	8,688	104.190	905,202.72	
VISA INC-CLASS A SHARES	126,723	283.040	35,867,677.92	
AFLAC INC	44,628	84.370	3,765,264.36	
ALLSTATE CORP	20,503	162.200	3,325,586.60	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,866	132.450	644,501.70	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	55,264	76.270	4,214,985.28	
AON PLC-CLASS A	15,769	318.990	5,030,153.31	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,061	91.880	2,670,124.68	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,577	253.170	4,196,799.09	
ASSURANT INC	4,977	181.160	901,633.32	
BROWN & BROWN INC	18,424	84.940	1,564,934.56	
CHUBB LTD	32,924	256.290	8,438,091.96	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	13,251	119.900	1,588,794.90	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,244	416.790	935,276.76	
EVEREST GROUP LTD	3,547	392.870	1,393,509.89	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	19,058	49.280	939,178.24	

GLOBE LIFE INC	6,373	116.030	739,459.19	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	25,592	99.070	2,535,399.44	
LOEWS CORP	16,971	76.970	1,306,257.87	
MARKEL GROUP INC	957	1,523.040	1,457,549.28	
MARSH & MCLENNAN COS	39,623	206.340	8,175,809.82	
METLIFE INC	52,395	72.390	3,792,874.05	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	19,458	82.550	1,606,257.90	
PROGRESSIVE CORP	46,866	204.880	9,601,906.08	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	28,865	112.840	3,257,126.60	
TRAVELERS COS INC/THE	18,256	220.930	4,033,298.08	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	7,897	271.950	2,147,589.15	
WR BERKLEY CORP	18,153	85.510	1,552,263.03	
ACCENTURE PLC-CL A	50,124	374.600	18,776,450.40	
ADOBE INC	35,884	492.460	17,671,434.64	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	13,226	107.250	1,418,488.50	
ANSYS INC	6,763	327.880	2,217,452.44	
APPLOVIN CORP-CLASS A	15,026	63.130	948,591.38	
ASPEN TECHNOLOGY INC	1,901	194.920	370,542.92	
ATLASSIAN CORP-CL A	12,421	194.430	2,415,015.03	
AUTODESK INC	17,384	254.240	4,419,708.16	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	18,166	48.790	886,319.14	
BILL HOLDINGS INC	6,004	64.650	388,158.60	
CADENCE DESIGN SYS INC	21,421	298.440	6,392,883.24	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	7,561	164.590	1,244,464.99	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	22,962	91.600	2,103,319.20	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	41,604	75.330	3,134,029.32	
CONFLUENT INC-CLASS A	15,954	30.810	491,542.74	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	17,817	315.650	5,623,936.05	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,173	258.980	821,743.54	
DATADOG INC - CLASS A	22,908	120.420	2,758,581.36	
DOCUSIGN INC	17,164	56.770	974,400.28	
DROPBOX INC-CLASS A	16,584	23.820	395,030.88	
DYNATRACE INC	21,256	45.610	969,486.16	
EPAM SYSTEMS INC	4,815	298.890	1,439,155.35	
FAIR ISAAC CORP	1,871	1,211.810	2,267,296.51	
FORTINET INC	52,961	66.720	3,533,557.92	
GARTNER INC	6,179	470.970	2,910,123.63	
GEN DIGITAL INC	41,779	21.260	888,221.54	
GODADDY INC - CLASS A	11,895	117.190	1,393,975.05	
HUBSPOT INC	3,878	601.100	2,331,065.80	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	72,539	191.070	13,860,026.73	
INTUIT INC	22,300	625.520	13,949,096.00	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	4,648	247.000	1,148,056.00	
MICROSOFT CORP	564,526	416.420	235,079,916.92	

MONDAY.COM LTD	2,382	217.000	516,894.00	
MONGODB INC	5,921	355.440	2,104,560.24	
OKTA INC	13,914	106.100	1,476,275.40	
ORACLE CORP	131,791	125.540	16,545,042.14	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	146,227	23.490	3,434,872.23	
PALO ALTO NETWORKS INC	25,644	282.160	7,235,711.04	
PTC INC	9,246	181.810	1,681,015.26	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,664	547.350	4,742,240.40	
SALESFORCE INC	77,348	294.330	22,765,836.84	
SAMSARA INC-CL A	13,749	35.760	491,664.24	
SERVICENOW INC	16,283	743.910	12,113,086.53	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	21,974	156.970	3,449,258.78	
SPLUNK INC	12,234	156.900	1,919,514.60	
SYNOPSYS INC	12,237	550.030	6,730,717.11	
TWILIO INC - A	15,028	59.660	896,570.48	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,139	416.310	1,306,797.09	
UIPATH INC - CLASS A	25,298	22.750	575,529.50	
UNITY SOFTWARE INC	19,066	26.090	497,431.94	
VERISIGN INC	7,316	190.250	1,391,869.00	
WIX.COM LTD	5,348	135.570	725,028.36	
WORKDAY INC-CLASS A	16,772	268.270	4,499,424.44	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	18,307	65.960	1,207,529.72	
ZSCALER INC	7,508	194.030	1,456,777.24	
AMPHENOL CORP-CL A	48,323	109.300	5,281,703.90	
APPLE INC	1,174,480	172.620	202,738,737.60	
ARISTA NETWORKS INC	21,651	277.730	6,013,132.23	
CDW CORP/DE	10,704	245.510	2,627,939.04	
CISCO SYSTEMS INC	322,103	48.930	15,760,499.79	
CORNING INC	64,764	32.510	2,105,477.64	
DELL TECHNOLOGIES -C	18,797	107.000	2,011,279.00	
F5 INC	3,921	187.900	736,755.90	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	102,647	16.730	1,717,284.31	
HP INC	75,219	30.420	2,288,161.98	
JABIL INC	9,808	123.150	1,207,855.20	
JUNIPER NETWORKS INC	21,151	36.220	766,089.22	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	13,320	149.800	1,995,336.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,784	344.190	4,400,124.96	
NETAPP INC	17,045	102.350	1,744,555.75	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	15,879	86.010	1,365,752.79	
SUPER MICRO COMPUTER INC	4,017	1,068.830	4,293,490.11	
TE CONNECTIVITY LTD	25,716	139.160	3,578,638.56	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,432	415.120	1,424,691.84	
TRIMBLE INC	20,783	62.070	1,290,000.81	
WESTERN DIGITAL CORP	24,533	59.790	1,466,828.07	

ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,189	285.860	1,197,467.54	
ADVANCED MICRO DEVICES	129,086	191.060	24,663,171.16	
ANALOG DEVICES INC	38,973	195.200	7,607,529.60	
APPLIED MATERIALS INC	65,931	198.650	13,097,193.15	
BROADCOM INC	35,646	1,235.500	44,040,633.00	
ENPHASE ENERGY INC	10,381	107.730	1,118,345.13	
ENTEGRIS INC	12,569	136.000	1,709,384.00	
FIRST SOLAR INC	8,882	147.420	1,309,384.44	
INTEL CORP	333,261	42.640	14,210,249.04	
KLA CORP	11,071	683.900	7,571,456.90	
LAM RESEARCH CORP	10,683	910.090	9,722,491.47	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	11,073	75.650	837,672.45	
MARVELL TECHNOLOGY INC	70,092	66.870	4,687,052.04	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	44,600	88.640	3,953,344.00	
MICRON TECHNOLOGY INC	88,208	93.250	8,225,396.00	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	4,028	686.990	2,767,195.72	
NVIDIA CORP	197,544	878.365	173,515,735.56	
NXP SEMICONDUCTORS NV	20,596	237.540	4,892,373.84	
ON SEMICONDUCTOR	35,773	74.870	2,678,324.51	
QORVO INC	7,835	111.850	876,344.75	
QUALCOMM INC	89,333	167.200	14,936,477.60	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,506	104.070	1,405,569.42	
TERADYNE INC	10,642	103.060	1,096,764.52	
TEXAS INSTRUMENTS INC	72,570	172.520	12,519,776.40	
AT&T INC	571,612	17.050	9,745,984.60	
LIBERTY GLOBAL LTD-C	21,079	17.500	368,882.50	
T-MOBILE US INC	40,664	161.810	6,579,841.84	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	334,763	39.490	13,219,790.87	
AES CORP	54,086	15.010	811,830.86	
ALLIANT ENERGY CORP	21,204	48.390	1,026,061.56	
AMEREN CORPORATION	19,979	71.580	1,430,096.82	
AMERICAN ELECTRIC POWER	43,705	82.110	3,588,617.55	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,191	117.140	1,779,473.74	
ATMOS ENERGY CORP	10,802	114.550	1,237,369.10	
CENTERPOINT ENERGY INC	54,717	27.870	1,524,962.79	
CMS ENERGY CORP	23,541	57.820	1,361,140.62	
CONSOLIDATED EDISON INC	28,772	88.940	2,558,981.68	
CONSTELLATION ENERGY	25,008	165.520	4,139,324.16	
DOMINION ENERGY INC	66,086	47.840	3,161,554.24	
DTE ENERGY COMPANY	16,277	108.480	1,765,728.96	
DUKE ENERGY CORP	62,251	94.710	5,895,792.21	
EDISON INTERNATIONAL	32,299	68.800	2,222,171.20	
ENTERGY CORP	17,246	101.960	1,758,402.16	
ESSENTIAL UTILITIES INC	16,329	36.000	587,844.00	

EVERGY INC	17,275	51.600	891,390.00	
EVERSOURCE ENERGY	25,375	58.920	1,495,095.00	
EXELON CORP	76,292	36.480	2,783,132.16	
FIRSTENERGY CORP	45,110	37.950	1,711,924.50	
NEXTERA ENERGY INC	166,491	60.080	10,002,779.28	
NISOURCE INC	34,855	26.500	923,657.50	
NRG ENERGY INC	20,349	63.930	1,300,911.57	
P G & E CORP	159,724	16.250	2,595,515.00	
PPL CORP	55,523	26.640	1,479,132.72	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	39,818	63.780	2,539,592.04	
SEMPRA	48,838	70.010	3,419,148.38	
SOUTHERN CO/THE	89,277	69.090	6,168,147.93	
VISTRA CORP	25,777	61.560	1,586,832.12	
WEC ENERGY GROUP INC	25,816	80.780	2,085,416.48	
XCEL ENERGY INC	45,776	51.990	2,379,894.24	
ALPHABET INC-CL A	473,896	141.180	66,904,637.28	
ALPHABET INC-CL C	412,461	142.170	58,639,580.37	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,601	290.650	2,209,230.65	
COMCAST CORP-CLASS A	324,219	42.770	13,866,846.63	
ELECTRONIC ARTS INC	19,428	134.270	2,608,597.56	
FOX CORP - CLASS A	23,886	29.550	705,831.30	
FOX CORP - CLASS B	8,773	26.890	235,905.97	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	26,027	32.390	843,014.53	
LIBERTY BROADBAND-C	8,196	57.370	470,204.52	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW	12,383	29.710	367,898.93	
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	13,438	69.110	928,700.18	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	13,554	103.770	1,406,498.58	
MATCH GROUP INC	17,799	33.550	597,156.45	
META PLATFORMS INC-CLASS A	177,648	484.100	85,999,396.80	
NETFLIX INC	35,164	605.880	21,305,164.32	
NEWS CORP - CLASS A	34,405	25.510	877,671.55	
OMNICOM GROUP	15,106	92.260	1,393,679.56	
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	40,964	11.210	459,206.44	
PINTEREST INC- CLASS A	48,115	34.190	1,645,051.85	
ROBLOX CORP -CLASS A	37,893	39.240	1,486,921.32	
ROKU INC	9,945	63.990	636,380.55	
SEA LTD-ADR	28,343	58.130	1,647,578.59	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	56,550	4.050	229,027.50	
SNAP INC - A	86,463	11.190	967,520.97	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,652	143.910	1,820,749.32	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	36,722	76.720	2,817,311.84	
WALT DISNEY CO/THE	145,455	111.950	16,283,687.25	
WARNER BROS DISCOVERY INC	201,390	8.540	1,719,870.60	
CBRE GROUP INC - A	23,502	93.210	2,190,621.42	

	COSTAR GROUP INC	30,836	95.180	2,934,970.48	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	79,100	3.240	256,284.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	10,672	47.710	509,161.12	
	アメリカ・ドル小計	27,180,354		3,516,543,791.85 (525,090,318,999)	
カナダ・ドル	ARC RESOURCES LTD	44,923	23.330	1,048,053.59	
	CAMECO CORP	33,586	55.640	1,868,725.04	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	87,389	98.280	8,588,590.92	
	CENOVUS ENERGY INC	120,048	25.180	3,022,808.64	
	ENBRIDGE INC	171,808	48.060	8,257,092.48	
	IMPERIAL OIL LTD	16,267	91.360	1,486,153.12	
	KEYERA CORP	19,802	33.570	664,753.14	
	MEG ENERGY CORP	21,651	30.140	652,561.14	
	PARKLAND CORP	7,666	44.410	340,447.06	
	PEMBINA PIPELINE CORP	45,973	47.380	2,178,200.74	
	SUNCOR ENERGY INC	100,785	48.860	4,924,355.10	
	TC ENERGY CORP	81,340	54.490	4,432,216.60	
	TOURMALINE OIL CORP	26,107	61.550	1,606,885.85	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	41,898	75.780	3,175,030.44	
	BARRICK GOLD CORP	139,992	21.360	2,990,229.12	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,268	71.350	946,671.80	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	41,452	15.010	622,194.52	
	FRANCO-NEVADA CORP	14,724	154.970	2,281,778.28	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	56,432	16.240	916,455.68	
	KINROSS GOLD CORP	110,156	7.700	848,201.20	
	LUNDIN MINING CORP	46,446	13.580	630,736.68	
	NUTRIEN LTD	42,180	72.810	3,071,125.80	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	25,157	19.680	495,089.76	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	34,947	60.790	2,124,428.13	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,438	109.890	487,691.82	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	34,221	60.130	2,057,708.73	
	CAE INC	27,474	26.980	741,248.52	
	STANTEC INC	9,939	114.930	1,142,289.27	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	6,027	128.230	772,842.21	
	WSP GLOBAL INC	9,260	222.070	2,056,368.20	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	32,674	22.120	722,748.88	
	GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	15,630	45.730	714,759.90	
RB GLOBAL INC	15,569	101.880	1,586,169.72		
THOMSON REUTERS CORP	12,639	213.150	2,694,002.85		
AIR CANADA	12,083	18.270	220,756.41		
CANADIAN NATL RAILWAY CO	42,942	174.280	7,483,931.76		
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	75,033	121.460	9,113,508.18		
TFI INTERNATIONAL INC	6,995	204.830	1,432,785.85		
MAGNA INTERNATIONAL INC	22,436	71.100	1,595,199.60		

BRP INC/CA- SUB VOTING	3,082	83.030	255,898.46	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	11,302	46.330	523,621.66	
RESTAURANT BRANDS INTERN	22,860	106.950	2,444,877.00	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	4,737	131.880	624,715.56	
DOLLARAMA INC	24,084	105.320	2,536,526.88	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	63,190	83.720	5,290,266.80	
EMPIRE CO LTD 'A'	9,148	32.700	299,139.60	
LOBLAW COMPANIES LTD	11,573	150.640	1,743,356.72	
METRO INC/CN	18,929	73.920	1,399,231.68	
WESTON (GEORGE) LTD	4,984	180.170	897,967.28	
SAPUTO INC	18,270	25.800	471,366.00	
BANK OF MONTREAL	56,754	127.110	7,214,000.94	
BANK OF NOVA SCOTIA	95,377	67.440	6,432,224.88	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	73,290	66.690	4,887,710.10	
NATIONAL BANK OF CANADA	25,956	110.220	2,860,870.32	
ROYAL BANK OF CANADA	111,382	134.630	14,995,358.66	
TORONTO-DOMINION BANK	143,729	81.370	11,695,228.73	
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	31,451	55.460	1,744,272.46	
BROOKFIELD CORP	109,779	55.510	6,093,832.29	
IGM FINANCIAL INC	4,949	34.740	171,928.26	
ONEX CORPORATION	4,217	99.990	421,657.83	
TMX GROUP LTD	26,034	33.700	877,345.80	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,745	1,519.900	2,652,225.50	
GREAT-WEST LIFECO INC	22,964	42.480	975,510.72	
IA FINANCIAL CORP INC	8,268	86.640	716,339.52	
INTACT FINANCIAL CORP	14,283	224.960	3,213,103.68	
MANULIFE FINANCIAL CORP	144,268	32.670	4,713,235.56	
POWER CORP OF CANADA	50,268	38.720	1,946,376.96	
SUN LIFE FINANCIAL INC	46,259	73.970	3,421,778.23	
CGI INC	15,720	158.020	2,484,074.40	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,609	3,750.810	6,035,053.29	
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,424	125.080	803,513.92	
OPEN TEXT CORP	21,507	52.140	1,121,374.98	
SHOPIFY INC - CLASS A	96,532	104.480	10,085,663.36	
BCE INC	8,653	46.610	403,316.33	
QUEBECOR INC -CL B	14,578	31.240	455,416.72	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	28,451	57.650	1,640,200.15	
TELUS CORP	15,222	22.420	341,277.24	
ALTAGAS LTD	27,309	29.300	800,153.70	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,200	32.320	361,984.00	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	7,344	30.700	225,460.80	
EMERA INC	22,591	47.700	1,077,590.70	
FORTIS INC	41,868	53.800	2,252,498.40	
HYDRO ONE LTD	24,747	41.020	1,015,121.94	

	NORTHLAND POWER INC	15,741	22.600	355,746.60	
	FIRSTSERVICE CORP	3,669	227.630	835,174.47	
	カナダ・ドル小計	3,197,654		211,808,385.81 (23,351,874,537)	
オーストラ リア・ドル	AMPOL LTD	19,016	38.150	725,460.40	
	SANTOS LTD	278,806	7.340	2,046,436.04	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	146,210	29.860	4,365,830.60	
	BHP GROUP LTD	403,597	42.410	17,116,548.77	
	BLUESCOPE STEEL LTD	37,214	22.160	824,662.24	
	FORTESCUE LTD	135,233	23.960	3,240,182.68	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	36,927	59.470	2,196,048.69	
	MINERAL RESOURCES LTD	11,662	65.910	768,642.42	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	92,960	13.700	1,273,552.00	
	ORICA LTD	36,212	17.250	624,657.00	
	PILBARA MINERALS LTD	280,194	3.910	1,095,558.54	
	RIO TINTO LTD	29,368	116.950	3,434,587.60	
	SOUTH32 LTD	336,639	3.000	1,009,917.00	
	REECE LTD	13,059	28.000	365,652.00	
	SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	16,425	40.610	667,019.25	
	BRAMBLES LTD	105,161	15.190	1,597,395.59	
	COMPUTERSHARE LTD	50,853	24.720	1,257,086.16	
	AURIZON HOLDINGS LTD	130,251	3.840	500,163.84	
	QANTAS AIRWAYS LTD	78,226	5.110	399,734.86	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	45,243	44.300	2,004,264.90	
	IDP EDUCATION LTD	23,591	19.060	449,644.46	
	LOTTERY CORP LTD/THE	173,268	5.120	887,132.16	
	WESFARMERS LTD	92,796	67.120	6,228,467.52	
	COLES GROUP LTD	99,972	16.700	1,669,532.40	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	138,738	5.240	726,987.12	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	98,099	32.650	3,202,932.35	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	62,913	12.480	785,154.24	
	COCHLEAR LTD	5,404	332.980	1,799,423.92	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	14,565	54.630	795,685.95	
	SONIC HEALTHCARE LTD	37,362	28.050	1,048,004.10	
	CSL LTD	38,360	280.210	10,748,855.60	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	237,876	28.690	6,824,662.44	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	133,914	115.540	15,472,423.56		
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	252,991	33.810	8,553,625.71		
WESTPAC BANKING CORP	287,982	26.190	7,542,248.58		
ASX LTD	15,385	67.540	1,039,102.90		
MACQUARIE GROUP LTD	28,015	197.710	5,538,845.65		
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	22,786	35.080	799,332.88		
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	173,755	6.280	1,091,181.40		
MEDIBANK PRIVATE LTD	193,702	3.840	743,815.68		

	QBE INSURANCE GROUP LTD	124,450	17.560	2,185,342.00	
	SUNCORP GROUP LTD	88,234	15.790	1,393,214.86	
	WISETECH GLOBAL LTD	12,907	94.430	1,218,808.01	
	XERO LTD	11,173	135.150	1,510,030.95	
	TELSTRA GROUP LTD	273,343	3.830	1,046,903.69	
	ORIGIN ENERGY LTD	134,865	9.120	1,229,968.80	
	CAR GROUP LTD	33,837	34.640	1,172,113.68	
	REA GROUP LTD	3,813	177.500	676,807.50	
	SEEK LTD	29,833	25.620	764,321.46	
	オーストラリア・ドル小計	5,127,185		132,657,970.15 (12,993,848,176)	
香港・ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	196,924	41.050	8,083,730.20	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	121,500	102.500	12,453,750.00	
	MTR CORP	118,500	25.400	3,009,900.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	160,000	14.880	2,380,800.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	176,000	40.250	7,084,000.00	
	SANDS CHINA LTD	172,800	21.200	3,663,360.00	
	WH GROUP LTD	722,000	5.350	3,862,700.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	247,000	21.050	5,199,350.00	
	HANG SENG BANK LTD	63,400	88.300	5,598,220.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	92,300	244.400	22,558,120.00	
	AIA GROUP LTD	921,000	61.000	56,181,000.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	41,000	46.200	1,894,200.00	
	CLP HOLDINGS LTD	142,100	63.950	9,087,295.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	861,389	5.930	5,108,036.77	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	111,000	46.150	5,122,650.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	160,924	37.400	6,018,557.60	
	ESR GROUP LTD	157,000	8.580	1,347,060.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	190,000	8.620	1,637,800.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	145,384	23.200	3,372,908.80	
	SINO LAND CO	248,200	8.330	2,067,506.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	108,000	78.300	8,456,400.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	27,000	66.400	1,792,800.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	116,800	16.420	1,917,856.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	113,000	26.950	3,045,350.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	125,000	27.600	3,450,000.00	
	香港・ドル小計	5,538,221		184,393,350.37 (3,520,069,060)	
シンガポール・ドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	10,800	24.350	262,980.00	
	KEPPEL LTD	115,000	7.280	837,200.00	
	SEATRUM LTD	3,231,727	0.089	287,623.70	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	108,600	3.940	427,884.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	113,566	6.380	724,551.08	
	GENTING SINGAPORE LTD	452,500	0.885	400,462.50	

	WILMAR INTERNATIONAL LTD	159,600	3.390	541,044.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	148,700	34.670	5,155,429.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	270,600	13.320	3,604,392.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	102,400	28.920	2,961,408.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	65,200	9.430	614,836.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	645,315	2.480	1,600,381.20	
	SEBACORP INDUSTRIES LTD	89,200	5.050	450,460.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	220,100	2.670	587,667.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	49,000	5.910	289,590.00	
	シンガポール・ドル小計	5,782,308		18,745,908.48 (2,091,106,091)	
ニュージー ランド・ド ル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	96,702	8.240	796,824.48	
	EBOS GROUP LTD	12,972	37.600	487,747.20	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	46,548	23.800	1,107,842.40	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	188,606	4.900	924,169.40	
	MERCURY NZ LTD	40,976	6.670	273,309.92	
	MERIDIAN ENERGY LTD	91,327	5.555	507,321.48	
	ニュージーランド・ドル小計	477,131		4,097,214.88 (372,395,860)	
イギリス・ ポンド	BP PLC	1,345,084	4.910	6,604,362.44	
	SHELL PLC	525,932	25.485	13,403,377.02	
	ANGLO AMERICAN PLC	104,777	18.546	1,943,194.24	
	ANTOFAGASTA PLC	30,983	19.480	603,548.84	
	CRH PLC	57,555	65.840	3,789,421.20	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,296	47.000	483,912.00	
	ENDEAVOUR MINING PLC	17,507	14.790	258,928.53	
	GLENCORE PLC	811,618	4.252	3,450,999.73	
	MONDI PLC	30,822	13.320	410,549.04	
	RIO TINTO PLC	90,715	48.620	4,410,563.30	
	ASHTREAD GROUP PLC	35,259	51.880	1,829,236.92	
	BAE SYSTEMS PLC	251,236	12.950	3,253,506.20	
	BUNZL PLC	26,105	30.040	784,194.20	
	DCC PLC	5,954	57.300	341,164.20	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	119,456	6.156	735,371.13	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	649,146	3.935	2,554,389.51	
	SMITHS GROUP PLC	24,369	16.160	393,803.04	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,904	105.250	621,396.00	
	EXPERIAN PLC	73,697	33.390	2,460,742.83	
	INTERTEK GROUP PLC	11,884	48.460	575,898.64	
	RELX PLC	152,138	33.750	5,134,657.50	
RENTOKIL INITIAL PLC	190,467	4.734	901,670.77		
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,766	4.736	306,731.77		
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,637	46.890	311,208.93		
BURBERRY GROUP PLC	26,233	12.695	333,027.93		

PERSIMMON PLC	27,665	12.875	356,186.87	
TAYLOR WIMPEY PLC	353,772	1.397	494,219.48	
COMPASS GROUP PLC	136,342	22.020	3,002,250.84	
ENTAIN PLC	42,158	7.740	326,302.92	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	13,924	171.150	2,383,092.60	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	14,491	80.640	1,168,554.24	
PEARSON PLC	46,942	10.185	478,104.27	
WHITBREAD PLC	16,522	32.120	530,686.64	
JD SPORTS FASHION PLC	251,482	1.118	281,156.87	
KINGFISHER PLC	179,593	2.269	407,496.51	
NEXT PLC	9,030	85.020	767,730.60	
OCADO GROUP PLC	42,697	4.590	195,979.23	
SAINSBURY (J) PLC	113,480	2.513	285,175.24	
TESCO PLC	551,571	2.876	1,586,318.19	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	30,992	23.420	725,832.64	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	167,558	23.405	3,921,694.99	
COCA-COLA HBC AG-DI	17,866	24.800	443,076.80	
DIAGEO PLC	179,783	29.070	5,226,291.81	
IMPERIAL BRANDS PLC	69,831	16.955	1,183,984.60	
HALEON PLC	482,378	3.223	1,554,704.29	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	56,558	44.860	2,537,191.88	
UNILEVER PLC	197,070	38.510	7,589,165.70	
NMC HEALTH PLC	3,940	0.010	39.40	
SMITH & NEPHEW PLC	57,278	10.630	608,865.14	
ASTRAZENECA PLC	124,946	102.940	12,861,941.24	
GSK PLC	326,183	16.496	5,380,714.76	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	14,590	18.470	269,477.30	
BARCLAYS PLC	1,208,742	1.769	2,138,264.59	
HSBC HOLDINGS PLC	1,552,941	5.980	9,286,587.18	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,165,051	0.495	2,556,700.24	
NATWEST GROUP PLC	407,238	2.402	978,185.67	
STANDARD CHARTERED PLC	182,397	6.540	1,192,876.38	
3I GROUP PLC	81,145	25.550	2,073,254.75	
ABRDN PLC	138,015	1.396	192,668.94	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	31,008	7.018	217,614.14	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	32,399	94.500	3,061,705.50	
M&G PLC	217,201	2.316	503,037.51	
SCHRODERS PLC	61,711	3.902	240,796.32	
ST JAMES'S PLACE PLC	33,823	4.253	143,849.21	
WISE PLC - A	43,661	9.228	402,903.70	
ADMIRAL GROUP PLC	19,808	27.340	541,550.72	
AVIVA PLC	217,835	4.824	1,050,836.04	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	457,083	2.439	1,114,825.43	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	59,286	5.044	299,038.58	

	PRUDENTIAL PLC	211,966	7.960	1,687,249.36	
	SAGE GROUP PLC/THE	75,045	12.135	910,671.07	
	HALMA PLC	32,277	22.140	714,612.78	
	BT GROUP PLC	540,623	1.085	586,575.95	
	VODAFONE GROUP PLC	1,981,261	0.698	1,382,920.17	
	CENTRICA PLC	403,810	1.323	534,240.63	
	NATIONAL GRID PLC	301,486	10.485	3,161,080.71	
	SEVERN TRENT PLC	20,117	25.750	518,012.75	
	SSE PLC	87,793	15.830	1,389,763.19	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	51,208	10.585	542,036.68	
	AUTO TRADER GROUP PLC	77,901	7.550	588,152.55	
	INFORMA PLC	102,755	8.212	843,824.06	
	WPP PLC	78,503	7.072	555,173.21	
	イギリス・bond小計	22,071,271		149,871,098.97 (28,494,992,047)	
イスラエル・シュケル	ICL GROUP LTD	67,143	17.700	1,188,431.10	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,213	730.200	1,615,932.60	
	BANK HAPOALIM BM	98,327	34.180	3,360,816.86	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	115,937	29.050	3,367,969.85	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	118,638	18.050	2,141,415.90	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	11,916	131.500	1,566,954.00	
	NICE LTD	4,458	868.100	3,869,989.80	
	AZRIELI GROUP LTD	3,527	254.100	896,210.70	
	イスラエル・シュケル小計	422,159		18,007,720.81 (732,154,311)	
スイス・フラン	CLARIANT AG-REG	10,101	11.740	118,585.74	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	538	644.500	346,741.00	
	GIVAUDAN-REG	771	4,017.000	3,097,107.00	
	HOLCIM LTD	42,879	77.580	3,326,552.82	
	SIG GROUP AG	22,269	18.840	419,547.96	
	SIKA AG-REG	12,022	263.500	3,167,797.00	
	ABB LTD-REG	130,006	42.400	5,512,254.40	
	GEBERIT AG-REG	2,873	528.800	1,519,242.40	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,766	228.400	403,354.40	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,030	235.800	714,474.00	
	VAT GROUP AG	2,164	464.200	1,004,528.80	
	ADECCO GROUP AG-REG	14,810	35.670	528,272.70	
	SGS SA-REG	11,450	84.460	967,067.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	4,194	240.800	1,009,915.20	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	42,892	145.800	6,253,653.60	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	2,619	208.700	546,585.30	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	5,225	40.550	211,873.75	
	AVOLTA AG	8,656	35.530	307,547.68	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	216	1,333.000	287,928.00		

	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	72	11,000.000	792,000.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	109,400.000	875,200.00	
	NESTLE SA-REG	214,178	95.230	20,396,170.94	
	ALCON INC	41,643	75.520	3,144,879.36	
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,173	270.800	1,130,048.40	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,823	143.200	1,263,453.60	
	BACHEM HOLDING AG	1,756	81.050	142,323.80	
	LONZA GROUP AG-REG	5,801	474.000	2,749,674.00	
	NOVARTIS AG-REG	165,157	85.640	14,144,045.48	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,584	242.600	626,878.40	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	55,907	230.800	12,903,335.60	
	SANDOZ GROUP AG	30,936	28.250	873,942.00	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	3,006	104.200	313,225.20	
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,168	50.120	760,220.16	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,773	1,286.000	2,280,078.00	
	UBS GROUP AG-REG	264,202	28.180	7,445,212.36	
	BALOISE HOLDING AG - REG	3,909	146.100	571,104.90	
	HELVETIA HOLDING AG-REG	2,221	131.500	292,061.50	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,272	635.200	1,443,174.40	
	SWISS RE AG	24,764	113.750	2,816,905.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,811	486.600	5,747,232.60	
	TEMENOS AG - REG	3,743	66.800	250,032.40	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	13,555	84.240	1,141,873.20	
	SWISSCOM AG-REG	1,994	528.400	1,053,629.60	
	BKW AG	1,385	133.900	185,451.50	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,572	87.850	489,500.20	
	スイス・フラン小計	1,204,894		113,574,681.35 (19,192,985,401)	
デンマーク・クローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	30,327	408.200	12,379,481.40	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	407	2,164.000	880,748.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	78,424	187.960	14,740,575.04	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	206	8,905.000	1,834,430.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	412	9,056.000	3,731,072.00	
	DSV A/S	13,716	1,059.500	14,532,102.00	
	PANDORA A/S	6,892	1,146.000	7,898,232.00	
	CARLSBERG AS-B	8,080	920.800	7,440,064.00	
	COLOPLAST-B	10,365	939.400	9,736,881.00	
	DEMANT A/S	8,178	347.900	2,845,126.20	
	GENMAB A/S	5,493	2,045.000	11,233,185.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	259,962	904.000	235,005,648.00	
	DANSKE BANK A/S	59,312	206.400	12,241,996.80	
	TRYG A/S	24,975	144.050	3,597,648.75	
ORSTED A/S	14,988	348.600	5,224,816.80		
	デンマーク・クローネ小計	521,737		343,322,006.99	

				(7,484,419,752)	
ノル ウェー・ク ローネ	AKER BP ASA	21,204	265.700	5,633,902.80	
	EQUINOR ASA	72,237	277.550	20,049,379.35	
	NORSK HYDRO ASA	108,109	58.000	6,270,322.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,718	334.200	4,250,355.60	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	6,526	684.000	4,463,784.00	
	MOWI ASA	36,354	198.800	7,227,175.20	
	ORKLA ASA	63,195	75.780	4,788,917.10	
	SALMAR ASA	6,204	696.600	4,321,706.40	
	DNB BANK ASA	78,029	208.000	16,230,032.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,691	168.000	3,140,088.00	
	TELENOR ASA	48,435	115.450	5,591,820.75	
	ADEVINTA ASA	21,858	113.100	2,472,139.80	
ノルウェー・クローネ小計		493,560		84,439,623.00 (1,188,909,892)	
スウェーデ ン・クロ ーナ	BOLIDEN AB	20,658	294.950	6,093,077.10	
	HOLMEN AB-B SHARES	7,024	423.500	2,974,664.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	45,662	152.850	6,979,436.70	
	ALFA LAVAL AB	23,093	421.300	9,729,080.90	
	ASSA ABLOY AB-B	80,816	307.500	24,850,920.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	217,094	184.200	39,988,714.80	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	125,066	161.000	20,135,626.00	
	BEIJER REF AB	23,918	133.600	3,195,444.80	
	EPIROC AB-A	56,566	206.800	11,697,848.80	
	EPIROC AB-B	33,182	184.800	6,132,033.60	
	HUSQVARNA AB-B SHS	34,897	84.000	2,931,348.00	
	INDUTRADE AB	17,913	281.200	5,037,135.60	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,223	272.800	2,243,234.40	
	LIFCO AB-B SHS	15,149	277.200	4,199,302.80	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	109,274	55.180	6,029,739.32	
	SAAB AB-B	6,953	870.000	6,049,110.00	
	SANDVIK AB	87,237	242.900	21,189,867.30	
	SKANSKA AB-B SHS	26,915	195.000	5,248,425.00	
	SKF AB-B SHARES	31,715	236.500	7,500,597.50	
	VOLVO AB-A SHS	13,283	309.200	4,107,103.60	
	VOLVO AB-B SHS	124,286	307.850	38,261,445.10	
	SECURITAS AB-B SHS	41,010	107.650	4,414,726.50	
	VOLVO CAR AB-B	100,230	34.270	3,434,882.10	
	EVOLUTION AB	14,444	1,370.400	19,794,057.60	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	52,210	145.900	7,617,439.00		
ESSITY AKTIEBOLAG-B	45,427	250.100	11,361,292.70		
GETINGE AB-B SHS	21,124	214.100	4,522,648.40		
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	13,513	271.200	3,664,725.60		
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	129,315	154.850	20,024,427.75		

	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	113,533	120.350	13,663,696.55	
	SWEDBANK AB - A SHARES	63,538	228.400	14,512,079.20	
	EQT AB	29,893	341.400	10,205,470.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	10,598	375.200	3,976,369.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,642	374.200	3,982,236.40	
	INVESTOR AB-B SHS	141,543	270.850	38,336,921.55	
	LUNDBERGS AB-B SHS	6,081	578.200	3,516,034.20	
	ERICSSON LM-B SHS	221,040	59.350	13,118,724.00	
	HEXAGON AB-B SHS	175,674	125.500	22,047,087.00	
	TELE2 AB-B SHS	38,424	88.140	3,386,691.36	
	TELIA CO AB	187,675	25.790	4,840,138.25	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	60,454	71.480	4,321,251.92	
	SAGAX AB-B	14,721	261.400	3,848,069.40	
	スウェーデン・クローナ小計	2,600,013		449,163,124.60 (6,467,948,994)	
ユーロ	ENI SPA	179,276	14.506	2,600,577.65	
	GALP ENERGIA SGPS SA	31,541	15.190	479,107.79	
	NESTE OYJ	31,509	24.780	780,793.02	
	OMV AG	10,043	41.390	415,679.77	
	REPSOL SA	96,457	15.025	1,449,266.42	
	TENARIS SA	41,201	17.740	730,905.74	
	TOTALENERGIES SE	175,277	62.480	10,951,306.96	
	AIR LIQUIDE SA	41,216	195.140	8,042,890.24	
	AKZO NOBEL N.V.	12,475	65.500	817,112.50	
	ARCELORMITTAL	44,177	24.215	1,069,746.05	
	ARKEMA	5,145	91.840	472,516.80	
	BASF SE	70,317	49.310	3,467,331.27	
	COVESTRO AG	16,049	47.910	768,907.59	
	DSM-FIRMENICH AG	13,915	100.940	1,404,580.10	
	EVONIK INDUSTRIES AG	17,669	17.060	301,433.14	
	HEIDELBERG MATERIALS AG	11,273	93.040	1,048,839.92	
	OCI NV	11,025	24.450	269,561.25	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	20,828	41.800	870,610.40	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	47,758	11.785	562,828.03	
	SYENSQO SA	4,802	81.390	390,834.78	
	SYMRISE AG	9,721	107.850	1,048,409.85	
	UMICORE	16,912	20.700	350,078.40	
	UPM-KYMMENE OYJ	42,123	29.300	1,234,203.90	
	VOESTALPINE AG	9,720	24.880	241,833.60	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	19,741	39.860	786,876.26	
	AIRBUS SE	47,599	162.760	7,747,213.24	
	ALSTOM	25,574	12.310	314,815.94	
	BOUYGUES SA	17,123	37.300	638,687.90	
	BRENTAG SE	12,153	78.440	953,281.32	

COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	34,454	69.710	2,401,788.34	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	44,374	46.680	2,071,378.32	
DASSAULT AVIATION SA	1,720	178.300	306,676.00	
EIFFAGE	6,641	102.800	682,694.80	
FERROVIAL SE	42,157	36.300	1,530,299.10	
GEA GROUP AG	10,467	38.360	401,514.12	
IMCD NV	4,340	160.250	695,485.00	
KINGSPAN GROUP PLC	13,174	83.180	1,095,813.32	
KNORR-BREMSE AG	7,217	68.040	491,044.68	
KONE OYJ-B	27,371	42.970	1,176,131.87	
LEGRAND SA	19,539	97.740	1,909,741.86	
LEONARDO SPA	35,486	21.280	755,142.08	
METSO CORP	50,483	10.560	533,100.48	
MTU AERO ENGINES AG	3,854	224.600	865,608.40	
PRYSMIAN SPA	19,681	47.610	937,012.41	
RATIONAL AG	350	747.500	261,625.00	
REXEL SA	23,491	24.730	580,932.43	
RHEINMETALL AG	3,447	456.900	1,574,934.30	
SAFRAN SA	27,555	202.350	5,575,754.25	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	43,527	215.000	9,358,305.00	
SIEMENS AG-REG	60,728	184.960	11,232,250.88	
SIEMENS ENERGY AG	40,928	14.420	590,181.76	
THALES SA	8,928	146.650	1,309,291.20	
VINCI SA	38,750	117.000	4,533,750.00	
WARTSILA OYJ ABP	38,260	14.070	538,318.20	
BUREAU VERITAS SA	17,817	26.600	473,932.20	
RANDSTAD NV	8,946	50.400	450,878.40	
TELEPERFORMANCE	4,299	87.160	374,700.84	
WOLTERS KLUWER	18,802	144.550	2,717,829.10	
ADP	3,679	126.800	466,497.20	
AENA SME SA	5,640	178.250	1,005,330.00	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	50,885	6.824	347,239.24	
DHL GROUP	78,125	39.140	3,057,812.50	
GETLINK SE	30,428	15.395	468,439.06	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,500	105.680	2,589,160.00	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	3,679	99.550	366,244.45	
CONTINENTAL AG	8,078	66.620	538,156.36	
DR ING HC F PORSCHE AG	8,498	88.360	750,883.28	
FERRARI NV	10,029	388.200	3,893,257.80	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	65,924	73.100	4,819,044.40	
MICHELIN (CGDE)	51,844	34.840	1,806,244.96	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	14,142	47.270	668,492.34	
RENAULT SA	14,764	42.800	631,899.20	
STELLANTIS NV	177,200	26.030	4,612,516.00	

VOLKSWAGEN AG	1,960	131.900	258,524.00	
VOLKSWAGEN AG-PREF	16,257	113.780	1,849,721.46	
ADIDAS AG	13,498	205.000	2,767,090.00	
HERMES INTERNATIONAL	2,555	2,390.000	6,106,450.00	
KERING	5,801	426.150	2,472,096.15	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	22,217	862.300	19,157,719.10	
MONCLER SPA	15,710	69.260	1,088,074.60	
PUMA SE	9,601	41.790	401,225.79	
SEB SA	1,127	116.000	130,732.00	
ACCOR SA	16,469	41.700	686,757.30	
AMADEUS IT GROUP SA	34,652	57.500	1,992,490.00	
DELIVERY HERO SE	13,293	25.590	340,167.87	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,785	37.840	218,904.40	
SODEXO SA	6,960	77.760	541,209.60	
D'IETTEREN GROUP	1,885	197.300	371,910.50	
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL	89,198	45.080	4,021,045.84	
PROSUS NV	114,557	27.115	3,106,213.05	
ZALANDO SE	17,418	22.210	386,853.78	
CARREFOUR SA	49,914	15.700	783,649.80	
JERONIMO MARTINS	22,106	19.000	420,014.00	
KESKO OYJ-B SHS	20,250	17.045	345,161.25	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	71,069	27.555	1,958,306.29	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	71,161	55.390	3,941,607.79	
DANONE	50,315	59.600	2,998,774.00	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	48,521	9.554	463,569.63	
HEINEKEN HOLDING NV	7,962	71.050	565,700.10	
HEINEKEN NV	22,805	85.400	1,947,547.00	
JDE PEET'S NV	13,317	20.720	275,928.24	
KERRY GROUP PLC-A	12,402	82.180	1,019,196.36	
LOTUS BAKERIES	31	8,680.000	269,080.00	
PERNOD RICARD SA	16,118	151.400	2,440,265.20	
REMY COINTREAU	2,008	92.600	185,940.80	
BEIERSDORF AG	7,876	134.050	1,055,777.80	
HENKEL AG & CO KGAA	8,714	67.140	585,057.96	
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	15,381	74.560	1,146,807.36	
L'OREAL	19,010	446.150	8,481,311.50	
AMPLIFON SPA	10,123	32.390	327,883.97	
BIOMERIEUX	2,791	97.680	272,624.88	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,583	120.250	430,855.75	
DIASORIN SPA	1,313	91.720	120,428.36	
ESSILORLUXOTTICA	23,299	209.300	4,876,480.70	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	17,125	34.640	593,210.00	
FRESENIUS SE & CO KGAA	31,227	25.000	780,675.00	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	60,155	19.340	1,163,397.70	

SIEMENS HEALTHINEERS AG	23,498	55.860	1,312,598.28	
ARGENX SE	4,867	342.800	1,668,407.60	
BAYER AG-REG	75,808	26.235	1,988,822.88	
EUROFINS SCIENTIFIC	9,270	56.100	520,047.00	
GRIFOLS SA	15,169	7.530	114,222.57	
IPSEN	3,380	105.400	356,252.00	
MERCK KGAA	9,982	156.850	1,565,676.70	
ORION OYJ-CLASS B	10,542	35.480	374,030.16	
QIAGEN N.V.	20,951	40.105	840,239.85	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	8,068	52.840	426,313.12	
SANOFI	92,427	88.200	8,152,061.40	
SARTORIUS AG-VORZUG	2,164	362.200	783,800.80	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,207	272.500	601,407.50	
UCB SA	10,230	104.400	1,068,012.00	
ABN AMRO BANK NV-CVA	28,787	15.190	437,274.53	
AIB GROUP PLC	108,430	4.640	503,115.20	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	484,418	10.415	5,045,213.47	
BANCO BPM SPA	91,957	5.698	523,970.98	
BANCO SANTANDER SA	1,274,611	4.117	5,247,573.48	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	87,661	8.914	781,410.15	
BNP PARIBAS	80,474	61.210	4,925,813.54	
CAIXABANK SA	308,048	4.501	1,386,524.04	
COMMERZBANK AG	82,105	11.925	979,102.12	
CREDIT AGRICOLE SA	90,899	13.020	1,183,504.98	
ERSTE GROUP BANK AG	29,155	39.030	1,137,919.65	
FINECOBANK SPA	43,093	13.325	574,214.22	
ING GROEP NV	270,895	14.060	3,808,783.70	
INTESA SANPAOLO	1,152,986	3.227	3,720,685.82	
KBC GROUP NV	20,304	69.040	1,401,788.16	
MEDIOBANCA SPA	47,708	13.100	624,974.80	
NORDEA BANK ABP	243,753	11.080	2,700,783.24	
SOCIETE GENERALE SA	55,196	23.730	1,309,801.08	
UNICREDIT SPA	121,851	32.900	4,008,897.90	
ADYEN NV	1,711	1,457.000	2,492,927.00	
AMUNDI SA	3,955	60.000	237,300.00	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	146,020	13.628	1,989,960.56	
DEUTSCHE BOERSE AG	14,432	185.250	2,673,528.00	
EDENRED	20,297	48.940	993,335.18	
EURAZEO SE	3,897	78.000	303,966.00	
EURONEXT NV	7,818	86.500	676,257.00	
EXOR NV	8,669	101.550	880,336.95	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	7,933	68.920	546,742.36	
NEXI SPA	57,060	6.284	358,565.04	
SOFINA	804	200.600	161,282.40	

WORLDLINE SA	16,677	10.415	173,690.95
AEGON LTD	127,748	5.332	681,152.33
AGEAS	11,247	39.900	448,755.30
ALLIANZ SE-REG	31,873	266.650	8,498,935.45
ASR NEDERLAND NV	14,593	42.400	618,743.20
ASSICURAZIONI GENERALI	82,510	22.730	1,875,452.30
AXA SA	148,668	34.325	5,103,029.10
HANNOVER RUECK SE	5,315	244.600	1,300,049.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	10,609	445.800	4,729,492.20
NN GROUP NV	20,802	40.860	849,969.72
POSTE ITALIANE SPA	34,720	11.720	406,918.40
SAMPO OYJ-A SHS	36,423	41.000	1,493,343.00
TALANX AG	5,345	70.650	377,624.25
BECHTLE AG	8,953	49.370	442,009.61
CAPGEMINI SE	12,750	223.000	2,843,250.00
DASSAULT SYSTEMES SE	50,781	41.600	2,112,489.60
NEMETSCHKE SE	5,941	83.560	496,429.96
SAP SE	83,000	171.920	14,269,360.00
NOKIA OYJ	404,925	3.360	1,360,548.00
ASM INTERNATIONAL NV	3,686	553.100	2,038,726.60
ASML HOLDING NV	32,361	857.700	27,756,029.70
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	6,286	141.450	889,154.70
INFINEON TECHNOLOGIES AG	102,926	31.910	3,284,368.66
STMICROELECTRONICS NV	54,733	41.400	2,265,946.20
CELLNEX TELECOM SA	32,894	32.200	1,059,186.80
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	258,987	21.810	5,648,506.47
ELISA OYJ	14,245	42.100	599,714.50
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	28,190	10.470	295,149.30
KONINKLIJKE KPN NV	300,581	3.391	1,019,270.17
ORANGE	132,722	10.524	1,396,766.32
TELECOM ITALIA SPA	696,355	0.218	151,805.39
TELEFONICA SA	412,202	3.917	1,614,595.23
ACCIONA SA	1,810	112.900	204,349.00
E.ON SE	178,555	12.700	2,267,648.50
EDP RENOVAVEIS SA	27,294	13.150	358,916.10
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	265,763	3.615	960,733.24
ELIA GROUP SA/NV	2,111	96.600	203,922.60
ENAGAS SA	14,471	13.260	191,885.46
ENDESA SA	25,535	16.320	416,731.20
ENEL SPA	662,902	6.131	4,064,252.16
ENGIE	142,233	15.380	2,187,543.54
FORTUM OYJ	42,339	11.645	493,037.65
IBERDROLA SA	490,939	10.980	5,390,510.22
REDEIA CORP SA	34,539	15.275	527,583.22

RWE AG	48,289	31.010	1,497,441.89	
SNAM SPA	168,809	4.362	736,344.85	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA	101,686	7.474	760,001.16	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	57,958	29.250	1,695,271.50	
VERBUND AG	5,338	67.200	358,713.60	
BOLLORE SE	69,288	6.085	421,617.48	
PUBLICIS GROUPE	18,281	98.980	1,809,453.38	
SCOUT24 SE	6,149	69.160	425,264.84	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	66,170	27.320	1,807,764.40	
VIVENDI SE	57,161	9.970	569,895.17	
LEG IMMOBILIEN SE	6,505	70.120	456,130.60	
VONOVIA SE	55,940	23.990	1,342,000.60	
ユーロ小計	14,206,942		411,638,916.02 (66,924,254,968)	
合計	88,823,429		697,905,278,088 (697,905,278,088)	

(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	590銘柄	72.6%	75.2%
カナダ・ドル	株式	85銘柄	3.2%	3.3%
オーストラリア・ドル	株式	49銘柄	1.8%	1.9%
香港・ドル	株式	25銘柄	0.5%	0.5%
シンガポール・ドル	株式	15銘柄	0.3%	0.3%
ニュージーランド・ドル	株式	6銘柄	0.1%	0.1%
イギリス・ポンド	株式	82銘柄	3.9%	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	45銘柄	2.7%	2.8%
デンマーク・クローネ	株式	15銘柄	1.0%	1.1%
ノルウェー・クローネ	株式	12銘柄	0.2%	0.2%
スウェーデン・クローナ	株式	42銘柄	0.9%	0.9%
ユーロ	株式	217銘柄	9.3%	9.6%

(b)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	13,343.00	1,651,196.25	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	26,290.00	953,801.20	
		AMERICAN TOWER CORP	36,440.00	7,191,069.60	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	35,166.00	685,033.68	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,975.00	2,201,244.50	
		BOSTON PROPERTIES INC	13,802.00	864,005.20	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,861.00	774,229.89	
		CROWN CASTLE INC	33,131.00	3,504,265.87	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	24,875.00	3,503,892.50	

	EQUINIX INC	7,520.00	6,394,932.80	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,256.00	932,770.08	
	EQUITY RESIDENTIAL	26,128.00	1,646,847.84	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,455.00	1,304,126.85	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	17,630.00	2,456,387.90	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	22,625.00	1,021,292.50	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	65,292.00	1,125,634.08	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	59,277.00	1,215,771.27	
	INVITATION HOMES INC	44,730.00	1,563,760.80	
	IRON MOUNTAIN INC	23,774.00	1,868,874.14	
	KIMCO REALTY CORP	57,934.00	1,093,793.92	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,567.00	1,246,962.78	
	PROLOGIS INC	74,899.00	9,663,468.98	
	PUBLIC STORAGE	12,964.00	3,591,546.56	
	REALTY INCOME CORP	63,896.00	3,334,732.24	
	REGENCY CENTERS CORP	13,101.00	774,007.08	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,176.00	1,761,764.48	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	25,788.00	3,888,056.76	
	SUN COMMUNITIES INC	10,118.00	1,325,356.82	
	UDR INC	27,406.00	1,018,681.02	
	VENTAS INC	34,880.00	1,481,702.40	
	VICI PROPERTIES INC	76,652.00	2,217,542.36	
	WELLTOWER INC	45,762.00	4,180,358.70	
	WEYERHAEUSER CO	54,126.00	1,858,145.58	
	WP CAREY INC	16,778.00	939,400.22	
	アメリカ・ドル小計	1,021,617.00	79,234,656.85 (11,831,318,961)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,170.00	392,650.20	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,441.00	132,449.80	
	カナダ・ドル小計	15,611.00	525,100.00 (57,892,275)	
オーストラリア・ドル	APA GROUP	108,912.00	894,167.52	
	DEXUS/AU	79,604.00	602,602.28	
	GOODMAN GROUP	133,948.00	4,133,635.28	
	GPT GROUP	159,776.00	704,612.16	
	MIRVAC GROUP	326,863.00	709,292.71	
	SCENTRE GROUP	452,086.00	1,509,967.24	
	STOCKLAND	193,824.00	940,046.40	
	TRANSURBAN GROUP	235,928.00	3,059,986.16	
	VICINITY CENTRES	372,431.00	782,105.10	
	オーストラリア・ドル小計	2,063,372.00	13,336,414.85 (1,306,301,835)	
香港・ドル	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	276,000.00	2,511,600.00	
	LINK REIT	189,400.00	6,922,570.00	

香港・ドル小計		465,400.00	9,434,170.00 (180,098,304)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	322,200.00	857,052.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	408,716.00	784,734.72	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	208,100.00	299,664.00	
	MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	112,400.00	143,872.00	
シンガポール・ドル小計		1,051,416.00	2,085,322.72 (232,617,748)	
イギリス・ ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	59,857.00	369,197.97	
	SEGRO PLC	89,254.00	757,052.42	
イギリス・ポンド小計		149,111.00	1,126,250.39 (214,133,987)	
ユーロ	COVIVIO	7,110.00	301,179.60	
	GECINA SA	3,082.00	280,153.80	
	KLEPIERRE	18,172.00	429,586.08	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	8,942.00	625,761.16	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	14,027.00	344,222.58	
ユーロ小計		51,333.00	1,980,903.22 (322,055,246)	
投資証券合計			14,144,418,355 (14,144,418,355)	
合 計			14,144,418,355 (14,144,418,355)	

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

通貨	銘柄数		組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券	34銘柄	1.6%	83.6%
カナダ・ドル	投資証券	2銘柄	0.0%	0.4%
オーストラリア・ドル	投資証券	9銘柄	0.2%	9.2%
香港・ドル	投資証券	2銘柄	0.0%	1.3%
シンガポール・ドル	投資証券	4銘柄	0.0%	1.6%
イギリス・ポンド	投資証券	2銘柄	0.0%	1.5%
ユーロ	投資証券	5銘柄	0.0%	2.3%

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。

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3月18日現在)

資産の部

流動資産

預金

2,140,847,546

金銭信託

3,750,661

コール・ローン	139,931,363
株式	35,337,370,028
投資信託受益証券	1,758,891,355
投資証券	3,317,401,573
派生商品評価勘定	492,184
未収配当金	84,703,418
差入委託証拠金	715,231,158
流動資産合計	43,498,619,286
資産合計	43,498,619,286
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	36,097,465
未払解約金	14,934,712
その他未払費用	221
流動負債合計	51,032,398
負債合計	51,032,398
純資産の部	
元本等	
元本	22,032,341,427
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	21,415,245,461
元本等合計	43,447,586,888
純資産合計	43,447,586,888
負債純資産合計	43,498,619,286

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2023年3月24日 至 2024年3月18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3月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	22,032,341,427口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.9720円 (1万口当たりの純資産額19,720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3月24日 至 2024年3月18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、投資信託受益証券、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、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3月18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3月18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 JUN24	3,095,523,056	-	3,059,425,693	36,097,363
	小計	3,095,523,056	-	3,059,425,693	36,097,363
合 計		3,095,523,056	-	3,059,425,693	36,097,363

(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	92,500,000	-	92,992,082	492,082
	小計	92,500,000	-	92,992,082	492,082
合 計		92,500,000	-	92,992,082	492,082

(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3月24日

至 2024年3月18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3月18日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	18,234,888,009円
同期中における追加設定元本額	6,979,915,149円
同期中における一部解約元本額	3,182,461,731円
2024年3月18日現在の元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	11,648,252,461円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	3,345,187,025円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	253,413,519円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	351,795,377円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	229,604,511円
イオン・バランス戦略ファンド	30,517,268円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	60,114,964円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	122,188,331円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	95,743,900円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	455,811,882円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	304,651,806円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	455,919,044円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	135,091,162円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	6,217,163円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	487,918,363円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	3,852,346,560円
三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド	76,895,879円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	6,903,905円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	4,307,757円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	6,164,014円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	1,950,038円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	1,132,486円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	148,643円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	2,545,908円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	13,546,460円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	9,534,537円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	3,832,033円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	70,606,431円
合計	22,032,341,427円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	

アメリカ・ドル	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	36,700	2.041	74,904.70	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	7,495	17.520	131,312.40	
	SOUTHERN COPPER CORP	3,255	103.000	335,265.00	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	16,075	21.810	350,595.75	
	NIO INC - ADR	51,172	5.580	285,539.76	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	7,842	39.090	306,543.78	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	16,231	12.020	195,096.62	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	15,709	41.950	658,992.55	
	PDD HOLDINGS INC	22,721	123.740	2,811,496.54	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	13,170	17.220	226,787.40	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	2,555	64.020	163,571.10	
	CREDICORP LTD	2,559	172.600	441,683.40	
	QIFU TECHNOLOGY INC	3,764	18.310	68,918.84	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	23,496	2.294	53,899.82	
	AUTOHOME INC-ADR	2,773	26.500	73,484.50	
	IQIYI INC-ADR	13,729	4.000	54,916.00	
	KANZHUN LTD - ADR	7,608	19.210	146,149.68	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	29,713	10.330	306,935.29	
	KE HOLDINGS INC-ADR	25,734	14.030	361,048.02	
アメリカ・ドル小計		302,301		7,047,141.15 (1,052,279,117)	
香港・ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	72,000	8.260	594,720.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	74,000	7.870	582,380.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	946,000	4.550	4,304,300.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	131,000	30.050	3,936,550.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	52,000	7.480	388,960.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	812,000	6.440	5,229,280.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	92,000	17.960	1,652,320.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	176,000	4.540	799,040.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	53,000	17.920	949,760.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	94,000	7.150	672,100.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	122,000	2.800	341,600.00	
	CMOC GROUP LTD-H	150,000	6.340	951,000.00	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO L-H	14,600	26.650	389,090.00	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	51,000	13.580	692,580.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	25,000	15.380	384,500.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	54,000	9.390	507,060.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	214,000	15.860	3,394,040.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	99,000	3.260	322,740.00	
	BOC AVIATION LTD	6,100	59.000	359,900.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	54,000	3.500	189,000.00	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	152,000	3.830	582,160.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	64,000	8.790	562,560.00		
CITIC LTD	233,000	8.080	1,882,640.00		

CRRC CORP LTD - H	144,000	4.260	613,440.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	72,000	4.300	309,600.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	21,000	20.300	426,300.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	39,000	5.460	212,940.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	30,000	19.540	586,200.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	68,000	15.520	1,055,360.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	19,400	24.750	480,150.00	
AIR CHINA LTD-H	56,000	4.070	227,920.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	60,140	9.350	562,309.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	100,400	8.530	856,412.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	66,000	4.370	288,420.00	
JD LOGISTICS INC	70,500	8.040	566,820.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	50,000	8.060	403,000.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	4,000	121.700	486,800.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	78,000	5.860	457,080.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	130,000	5.200	676,000.00	
BYD CO LTD-H	40,000	210.200	8,408,000.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	70,000	3.180	222,600.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	23,600	41.400	977,040.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	219,000	8.710	1,907,490.00	
GREAT WALL MOTOR CO LTD-H	85,000	9.380	797,300.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	81,200	3.330	270,396.00	
LI AUTO INC-CLASS A	44,000	147.300	6,481,200.00	
XPENG INC - CLASS A SHARES	46,700	37.800	1,765,260.00	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	48,000	13.700	657,600.00	
ZHEJIANG LEAPMOTOR TECHNOLOG	19,900	26.050	518,395.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	49,600	78.300	3,883,680.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	172,000	4.100	705,200.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	96,400	23.650	2,279,860.00	
LI NING CO LTD	85,000	20.700	1,759,500.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	30,000	67.950	2,038,500.00	
EAST BUY HOLDING LTD	13,000	23.900	310,700.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	59,000	17.240	1,017,160.00	
MEITUAN-CLASS B	193,460	89.400	17,295,324.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	57,400	73.850	4,238,990.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	52,400	19.720	1,033,328.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	29,000	8.940	259,260.00	
TRIP.COM GROUP LTD	21,100	344.200	7,262,620.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	617,500	71.900	44,398,250.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	5,000	80.600	403,000.00	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	68,200	12.780	871,596.00	
JD.COM INC-CLASS A	89,835	104.500	9,387,757.50	
MINISO GROUP HOLDING LTD	13,200	37.800	498,960.00	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	21,000	23.400	491,400.00	

TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	49,000	5.550	271,950.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	33,000	13.340	440,220.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	208,000	3.360	698,880.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	40,800	30.950	1,262,760.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	4,000	109.220	436,880.00	
CHINA FEIHE LTD	127,000	3.730	473,710.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	113,000	19.600	2,214,800.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	58,000	36.300	2,105,400.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	78,600	42.350	3,328,710.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	58,000	6.650	385,700.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	60,000	8.990	539,400.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	26,000	53.750	1,397,500.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	166,000	4.590	761,940.00	
GIANT BIOGENE HOLDING CO LTD	14,200	41.500	589,300.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	25,500	24.900	634,950.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	9,000	23.450	211,050.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	10,800	28.700	309,960.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	78,400	5.080	398,272.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	24,700	11.620	287,014.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	55,600	20.750	1,153,700.00	
AKESO INC	18,000	51.950	935,100.00	
BEIGENE LTD	24,700	104.000	2,568,800.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	44,000	12.300	541,200.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	54,500	5.080	276,860.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	324,800	6.700	2,176,160.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	50,000	17.200	860,000.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	48,000	15.320	735,360.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	48,500	42.650	2,068,525.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	16,500	14.480	238,920.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	387,000	3.260	1,261,620.00	
WUXI APPTec CO LTD-H	13,711	41.000	562,151.00	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	150,500	14.440	2,173,220.00	
ZAI LAB LTD	29,900	14.720	440,128.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,080,000	3.220	3,477,600.00	
BANK OF CHINA LTD-H	3,041,000	3.210	9,761,610.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	325,000	5.170	1,680,250.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	363,000	4.140	1,502,820.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	3,661,000	4.780	17,499,580.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	77,000	2.530	194,810.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	151,000	30.300	4,575,300.00	
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	265,100	2.700	715,770.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	2,490,000	3.980	9,910,200.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	326,000	4.090	1,333,340.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	400,000	0.710	284,000.00	

CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	132,000	4.060	535,920.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	58,400	9.850	575,240.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	64,500	13.960	900,420.00	
FAR EAST HORIZON LTD	84,000	6.070	509,880.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	27,200	8.690	236,368.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	80,800	3.950	319,160.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	43,200	9.350	403,920.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	292,000	9.500	2,774,000.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	96,800	13.780	1,333,904.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	61,000	6.950	423,950.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	30,100	14.360	432,236.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	308,000	2.540	782,320.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	250,000	10.660	2,665,000.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	256,500	35.550	9,118,575.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	19,800	12.140	240,372.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	104,000	9.150	951,600.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	33,000	22.450	740,850.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	29,000	29.500	855,500.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	18,500	15.220	281,570.00	
LENOVO GROUP LTD	316,000	9.500	3,002,000.00	
SUNNY OPTICAL TECH	26,200	52.900	1,385,980.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	590,200	14.540	8,581,508.00	
ZTE CORP-H	23,800	17.120	407,456.00	
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	17,000	18.720	318,240.00	
GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	846,000	1.290	1,091,340.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	19,000	16.980	322,620.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	154,000	6.190	953,260.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	1,554,000	0.940	1,460,760.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	17,000	29.600	503,200.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	100,000	1.960	196,000.00	
CGN POWER CO LTD-H	446,000	2.390	1,065,940.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	94,400	7.680	724,992.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	105,000	5.710	599,550.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	148,000	3.370	498,760.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	39,400	25.950	1,022,430.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	78,000	18.780	1,464,840.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	29,000	64.900	1,882,100.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	92,000	4.820	443,440.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	152,000	4.770	725,040.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	162,000	7.290	1,180,980.00	
BAIDU INC-CLASS A	86,350	101.300	8,747,255.00	
BILIBILI INC-CLASS Z	5,980	92.900	555,542.00	
CHINA LITERATURE LTD	12,200	26.400	322,080.00	
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	172,000	1.590	273,480.00	

	KINGSOFT CORP LTD	33,600	22.150	744,240.00	
	KUAISHOU TECHNOLOGY	91,100	50.650	4,614,215.00	
	NETEASE INC	73,800	170.100	12,553,380.00	
	TENCENT HOLDINGS LTD	250,800	283.800	71,177,040.00	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	21,000	11.420	239,820.00	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	138,500	10.980	1,520,730.00	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	50,000	6.520	326,000.00	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	126,000	25.200	3,175,200.00	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	23,400	24.600	575,640.00	
	CHINA VANKE CO LTD-H	78,900	5.870	463,143.00	
	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	74,000	5.740	424,760.00	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	63,000	10.540	664,020.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	64,600	4.920	317,832.00	
	香港・ドル小計	30,091,476		400,298,415.50 (7,641,696,752)	
台湾・ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	40,000	71.200	2,848,000.00	
	ASIA CEMENT CORP	73,000	41.100	3,000,300.00	
	CHINA STEEL CORP	424,000	23.850	10,112,400.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	128,000	55.600	7,116,800.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	138,000	68.600	9,466,800.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	171,000	54.500	9,319,500.00	
	TAIWAN CEMENT	270,676	31.950	8,648,098.20	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	5,000	1,070.000	5,350,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	105,000	32.900	3,454,500.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	3,000	1,790.000	5,370,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	108,000	37.050	4,001,400.00	
	CHINA AIRLINES LTD	106,000	19.350	2,051,100.00	
	EVA AIRWAYS CORP	91,000	31.350	2,852,850.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	39,096	166.500	6,509,484.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	64,000	30.350	1,942,400.00	
	WAN HAI LINES LTD	25,605	46.450	1,189,352.25	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	55,000	46.500	2,557,500.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	63,000	48.200	3,036,600.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	6,000	574.000	3,444,000.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	21,276	166.500	3,542,454.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	6,000	361.500	2,169,000.00	
	POU CHEN	70,000	33.050	2,313,500.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	12,200	656.000	8,003,200.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	21,000	267.500	5,617,500.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	188,000	77.500	14,570,000.00	
	PHARMAESSENTIA CORP	9,000	326.500	2,938,500.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	189,359	18.450	3,493,673.55	
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	668,000	31.750	21,209,000.00	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	550,360	26.200	14,419,432.00	

FIRST FINANCIAL HOLDING CO	412,501	27.600	11,385,027.60	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	354,970	23.000	8,164,310.00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	435,585	40.900	17,815,426.50	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	419,551	21.350	8,957,413.85	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	389,912	18.150	7,076,902.80	
TAIWAN BUSINESS BANK	213,032	16.350	3,483,073.20	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	389,563	26.050	10,148,116.15	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	143,299	46.400	6,649,073.60	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	57,832	177.000	10,236,264.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	368,013	30.200	11,113,992.60	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	361,000	47.650	17,201,650.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	639,196	14.150	9,044,623.40	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	295,897	69.600	20,594,431.20	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	498,432	8.380	4,176,860.16	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	18,000	454.000	8,172,000.00	
ACER INC	111,000	45.850	5,089,350.00	
ADVANTECH CO LTD	18,727	392.000	7,340,984.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	28,000	429.000	12,012,000.00	
AUO CORP	222,600	18.350	4,084,710.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	21,000	215.000	4,515,000.00	
COMPAL ELECTRONICS	157,000	37.000	5,809,000.00	
DELTA ELECTRONICS INC	75,000	303.000	22,725,000.00	
E INK HOLDINGS INC	32,000	234.000	7,488,000.00	
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	18,000	313.000	5,634,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	476,800	132.000	62,937,600.00	
INNOLUX CORP	292,163	14.950	4,367,836.85	
INVENTEC CORP	110,000	54.100	5,951,000.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	3,480	2,515.000	8,752,200.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	73,000	112.000	8,176,000.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	27,000	169.500	4,576,500.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	6,000	202.000	1,212,000.00	
PEGATRON CORP	81,000	89.100	7,217,100.00	
QUANTA COMPUTER INC	104,000	257.500	26,780,000.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	53,000	79.500	4,213,500.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	50,000	172.000	8,600,000.00	
WISTRON CORP	102,000	119.500	12,189,000.00	
WIWYNN CORP	3,000	2,200.000	6,600,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	62,520	92.100	5,758,092.00	
YAGEO CORPORATION	12,912	583.000	7,527,696.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	19,000	106.500	2,023,500.00	
ALCHIP TECHNOLOGIES LTD	3,000	3,605.000	10,815,000.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	119,000	153.000	18,207,000.00	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	3,000	2,700.000	8,100,000.00	
GLOBAL UNICHIP CORP	4,000	1,340.000	5,360,000.00	

	GLOBALWAFERS CO LTD	9,000	576.000	5,184,000.00	
	MEDIATEK INC	58,000	1,135.000	65,830,000.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	48,000	63.900	3,067,200.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	21,000	570.000	11,970,000.00	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	3,000	1,075.000	3,225,000.00	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	103,000	26.300	2,708,900.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	18,000	594.000	10,692,000.00	
	SILERGY CORP	13,800	378.000	5,216,400.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	933,000	753.000	702,549,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	427,000	51.900	22,161,300.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	40,000	83.900	3,356,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	118,000	26.500	3,127,000.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	147,000	122.500	18,007,500.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	72,000	78.700	5,666,400.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	73,000	99.300	7,248,900.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	43,443	35.000	1,520,505.00	
	台湾・ドル小計	13,062,800		1,490,358,682.91 (7,033,598,767)	
エジプト・ ポンド	EASTERN CO SAE	36,261	28.000	1,015,308.00	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BAN	96,608	91.650	8,854,123.20	
	EFG HOLDING S.A.E.	37,465	19.830	742,930.95	
	エジプト・ポンド小計	170,334		10,612,362.15 (33,130,732)	
トルコ・リ ラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	38,176	163.000	6,222,688.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	48,657	44.400	2,160,370.80	
	SASA POLYESTER SANAYI	46,408	37.920	1,759,791.36	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	50,276	57.650	2,898,411.40	
	KOC HOLDING AS	31,180	178.700	5,571,866.00	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	47,908	47.500	2,275,630.00	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	1,852	792.500	1,467,710.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	22,378	270.250	6,047,654.50	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	2,571	1,081.000	2,779,251.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	4,752	265.500	1,261,656.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	18,318	378.500	6,933,363.00	
	COCA-COLA ICECEK AS	3,549	556.000	1,973,244.00	
	AKBANK T.A.S.	108,288	39.720	4,301,199.36	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	35,457	77.300	2,740,826.10	
	TURKIYE IS BANKASI-C	320,199	10.240	3,278,837.76	
YAPI VE KREDI BANKASI	117,430	22.040	2,588,157.20		
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	42,053	63.600	2,674,570.80		
	トルコ・リラ小計	939,452		56,935,227.28 (265,574,368)	
メキシコ・ ペソ	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	117,900	97.850	11,536,515.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	6,795	229.620	1,560,267.90	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	40,100	34.950	1,401,495.00	

	ALFA S.A.B. -A	126,300	12.260	1,548,438.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	19,800	142.290	2,817,342.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	14,835	250.850	3,721,359.75	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	6,600	512.570	3,382,962.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL CENT	11,400	146.440	1,669,416.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	7,195	175.410	1,262,074.95	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	198,300	66.440	13,175,052.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	20,700	188.360	3,899,052.00	
	GRUMA S.A.B. -B	6,425	294.820	1,894,218.50	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	46,200	71.710	3,313,002.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	63,600	37.950	2,413,620.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	26,900	64.490	1,734,781.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	98,200	169.870	16,681,234.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	67,700	48.220	3,264,494.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER B	722,900	15.770	11,400,133.00	
	OPERADORA DE SITES MEX- A-1	47,400	19.600	929,040.00	
	メキシコ・ペソ小計	1,649,250		87,604,497.10 (783,035,275)	
フィリピン・ペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	51,690	48.700	2,517,303.00	
	AYALA CORPORATION	11,640	661.500	7,699,860.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	116,262	38.050	4,423,769.10	
	SM INVESTMENTS CORP	9,035	981.000	8,863,335.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	38,440	315.000	12,108,600.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	19,650	257.400	5,057,910.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	27,990	106.800	2,989,332.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	66,506	118.400	7,874,310.40	
	BDO UNIBANK INC	92,674	148.000	13,715,752.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	58,720	62.250	3,655,320.00	
	PLDT INC	2,690	1,355.000	3,644,950.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	10,060	355.000	3,571,300.00	
	AYALA LAND INC	275,600	32.400	8,929,440.00	
SM PRIME HOLDINGS INC	366,400	31.250	11,450,000.00		
	フィリピン・ペソ小計	1,147,357		96,501,181.50 (259,520,626)	
チリ・ペソ	EMPRESAS COPEC SA	13,877	6,750.000	93,669,750.00	
	EMPRESAS CMPC SA	36,662	1,748.000	64,085,176.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	5,698	47,749.000	272,073,802.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	747,361	70.500	52,688,950.50	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	6,352,877	11.610	73,756,901.97	
	FALABELLA SA	28,182	2,477.100	69,809,632.20	
	CENCOSUD SA	53,544	1,695.000	90,757,080.00	
	BANCO DE CHILE	1,720,479	110.200	189,596,785.80	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	3,107	27,290.000	84,790,030.00	
BANCO SANTANDER CHILE	2,408,919	48.200	116,109,895.80		

	ENEL AMERICAS SA	843,379	96.000	80,964,384.00	
	ENEL CHILE SA	971,320	57.800	56,142,296.00	
	チリ・ペソ小計	13,185,405		1,244,444,684.27 (197,086,438)	
コロンビア・ペソ	BANCOLOMBIA SA	9,095	31,700.000	288,311,500.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	16,140	31,400.000	506,796,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	19,631	19,960.000	391,834,760.00	
	コロンビア・ペソ小計	44,866		1,186,942,260.00 (45,620,126)	
インド・ルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	28,736	586.450	16,852,227.20	
	COAL INDIA LTD	58,312	415.250	24,214,058.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	19,879	468.850	9,320,269.15	
	INDIAN OIL CORP LTD	106,892	161.000	17,209,612.00	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	119,035	258.750	30,800,306.25	
	PETRONET LNG LTD	27,436	264.350	7,252,706.60	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	115,230	2,836.450	326,844,133.50	
	AMBUJA CEMENTS LTD	24,411	600.750	14,664,908.25	
	APL APOLLO TUBES LTD	6,265	1,474.700	9,238,995.50	
	ASIAN PAINTS LTD	14,521	2,867.550	41,639,693.55	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	13,000	557.800	7,251,400.00	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	10,470	2,197.100	23,003,637.00	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	53,203	532.550	28,333,257.65	
	JINDAL STEEL & POWER LTD	14,959	767.750	11,484,772.25	
	JSW STEEL LTD	22,672	780.650	17,698,896.80	
	NMDC LTD	43,717	198.350	8,671,266.95	
	PI INDUSTRIES LTD	3,459	3,649.150	12,622,409.85	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	5,741	2,868.000	16,465,188.00	
	SHREE CEMENT LTD	324	25,070.450	8,122,825.80	
	SRF LTD	5,058	2,428.550	12,283,605.90	
	SUPREME INDUSTRIES LTD	2,423	3,900.700	9,451,396.10	
	TATA STEEL LTD	287,020	141.700	40,670,734.00	
	ULTRATECH CEMENT LTD	4,481	9,632.950	43,165,248.95	
	UPL LTD	15,397	475.150	7,315,884.55	
	VEDANTA LTD	36,792	265.100	9,753,559.20	
	ABB INDIA LTD	2,065	5,616.550	11,598,175.75	
	ADANI ENTERPRISES LTD	6,696	3,132.200	20,973,211.20	
	ASHOK LEYLAND LTD	56,114	161.850	9,082,050.90	
	ASTRAL LTD	4,691	2,030.200	9,523,668.20	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	134,202	188.850	25,344,047.70	
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS	39,537	216.750	8,569,644.75	
	CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	23,122	469.700	10,860,403.40	
CUMMINS INDIA LTD	5,373	2,707.650	14,548,203.45		
HAVELLS INDIA LTD	9,425	1,482.300	13,970,677.50		
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	7,288	3,099.100	22,586,240.80		

LARSEN & TOUBRO LTD	25,492	3,537.150	90,169,027.80	
POLYCAB INDIA LTD	1,767	4,894.500	8,648,581.50	
SIEMENS LTD	3,370	4,771.300	16,079,281.00	
SUZLON ENERGY LTD	334,899	39.400	13,195,020.60	
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	9,083	912.500	8,288,237.50	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	19,519	1,283.000	25,042,877.00	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	10,064	865.750	8,712,908.00	
GMR AIRPORTS INFRASTRUCTURE	104,248	77.300	8,058,370.40	
INTERGLOBE AVIATION LTD	5,843	3,203.100	18,715,713.30	
BAJAJ AUTO LTD	2,566	8,350.700	21,427,896.20	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	2,486	2,267.000	5,635,762.00	
BHARAT FORGE LTD	8,900	1,119.500	9,963,550.00	
EICHER MOTORS LTD	5,181	3,745.650	19,406,212.65	
HERO MOTOCORP LTD	4,539	4,585.300	20,812,676.70	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	35,299	1,799.500	63,520,550.50	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	5,355	11,476.650	61,457,460.75	
MRF LTD	88	141,312.050	12,435,460.40	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	89,764	111.350	9,995,221.40	
SONA BLW PRECISION FORGINGS	15,537	641.600	9,968,539.20	
TATA MOTORS LTD	62,882	945.850	59,476,939.70	
TATA MOTORS LTD-A-DVR	17,075	624.050	10,655,653.75	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	4,025	3,560.650	14,331,616.25	
TVS MOTOR CO LTD	8,991	2,066.450	18,579,451.95	
PAGE INDUSTRIES LTD	194	34,661.300	6,724,292.20	
TITAN CO LTD	13,440	3,633.200	48,830,208.00	
INDIAN HOTELS CO LTD	32,256	562.300	18,137,548.80	
JUBILANT FOODWORKS LTD	14,355	447.550	6,424,580.25	
ZOMATO LTD	230,783	160.050	36,936,819.15	
TRENT LTD	6,771	4,063.900	27,516,666.90	
AVENUE SUPERMARTS LTD	6,442	3,932.100	25,330,588.20	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	4,328	4,974.200	21,528,337.60	
ITC LTD	113,334	419.100	47,498,279.40	
MARICO LTD	18,008	500.150	9,006,701.20	
NESTLE INDIA LTD	13,199	2,603.650	34,365,576.35	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	21,638	1,212.150	26,228,501.70	
UNITED SPIRITS LTD	10,302	1,117.400	11,511,454.80	
VARUN BEVERAGES LTD	17,210	1,434.200	24,682,582.00	
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	4,747	2,728.550	12,952,426.85	
DABUR INDIA LTD	21,140	526.550	11,131,267.00	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	16,369	1,212.700	19,850,686.30	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	31,125	2,327.700	72,449,662.50	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	3,981	5,983.200	23,819,119.20	
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	28,159	726.950	20,470,185.05	
AUROBINDO PHARMA LTD	11,043	1,001.350	11,057,908.05	

CIPLA LTD	19,015	1,488.050	28,295,270.75	
DIVI'S LABORATORIES LTD	4,834	3,485.400	16,848,423.60	
DR. REDDY'S LABORATORIES	4,591	6,284.900	28,853,975.90	
LUPIN LTD	9,298	1,636.800	15,218,966.40	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	37,028	1,548.200	57,326,749.60	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	3,991	2,594.450	10,354,449.95	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	6,667	578.250	3,855,192.75	
AXIS BANK LTD	86,382	1,046.400	90,390,124.80	
BANDHAN BANK LTD	26,591	183.150	4,870,141.65	
BANK OF BARODA	38,009	254.000	9,654,286.00	
HDFC BANK LIMITED	106,323	1,452.650	154,450,105.95	
ICICI BANK LTD	196,480	1,080.350	212,267,168.00	
IDFC FIRST BANK LTD	131,058	78.700	10,314,264.60	
INDUSIND BANK LTD	10,740	1,484.350	15,941,919.00	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	41,376	1,738.300	71,923,900.80	
PUNJAB NATIONAL BANK	83,349	117.750	9,814,344.75	
STATE BANK OF INDIA	67,556	731.900	49,444,236.40	
UNION BANK OF INDIA	56,109	148.000	8,304,132.00	
YES BANK LTD	449,730	23.800	10,703,574.00	
BAJAJ FINANCE LTD	10,526	6,514.350	68,570,048.10	
BAJAJ FINSERV LTD	14,493	1,571.450	22,775,024.85	
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	859	8,243.750	7,081,381.25	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	15,890	1,067.850	16,968,136.50	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	3,636	3,818.650	13,884,611.40	
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	105,812	344.750	36,478,687.00	
MUTHOOT FINANCE LTD	4,186	1,341.300	5,614,681.80	
ONE 97 COMMUNICATIONS LTD	8,908	370.700	3,302,195.60	
POWER FINANCE CORPORATION	55,029	381.000	20,966,049.00	
REC LTD	49,831	446.700	22,259,507.70	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	10,068	699.300	7,040,552.40	
SHRIRAM FINANCE LTD	10,283	2,266.800	23,309,504.40	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	36,629	632.350	23,162,348.15	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	9,130	1,651.350	15,076,825.50	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	12,502	567.750	7,098,010.50	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	17,053	1,500.000	25,579,500.00	
HCL TECHNOLOGIES LTD	35,865	1,647.300	59,080,414.50	
INFOSYS LTD	125,669	1,634.000	205,343,146.00	
LTIMINDTREE LTD	3,273	5,194.350	17,001,107.55	
MPHASIS LTD	2,360	2,487.850	5,871,326.00	
PERSISTENT SYSTEMS LTD	1,752	8,432.450	14,773,652.40	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	34,234	4,219.250	144,441,804.50	
TATA ELXSI LTD	1,296	7,707.000	9,988,272.00	
TECH MAHINDRA LTD	19,431	1,282.200	24,914,428.20	
WIPRO LTD	49,433	517.000	25,556,861.00	

	BHARTI AIRTEL LTD	86,133	1,220.000	105,082,260.00	
	TATA COMMUNICATIONS LTD	4,533	1,934.850	8,770,675.05	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	12,008	1,902.600	22,846,420.80	
	ADANI POWER LTD	29,195	530.400	15,485,028.00	
	GAIL INDIA LTD	87,099	173.800	15,137,806.20	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	11,856	412.550	4,891,192.80	
	NTPC LTD	165,150	316.300	52,236,945.00	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	176,004	265.950	46,808,263.80	
	TATA POWER CO LTD	53,868	380.750	20,510,241.00	
	INFO EDGE INDIA LTD	2,865	5,241.200	15,016,038.00	
	DLF LTD	29,330	823.700	24,159,121.00	
	GODREJ PROPERTIES LTD	5,192	2,218.250	11,517,154.00	
	MACROTECH DEVELOPERS LTD	8,447	1,003.950	8,480,365.65	
	インド・ルピー小計	5,412,698		3,938,328,531.20 (7,128,374,640)	
インドネシ ア・ルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBK P	454,200	2,660.000	1,208,172,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	65,100	24,175.000	1,573,792,500.00	
	AMMAN MINERAL INTERNASIONAL	228,300	8,725.000	1,991,917,500.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	303,800	1,615.000	490,637,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	891,211	985.000	877,842,835.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	90,200	8,550.000	771,210,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	380,461	2,290.000	871,255,690.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	160,200	5,850.000	937,170,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	731,200	5,175.000	3,783,960,000.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	30,787,100	71.000	2,185,884,100.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	716,700	2,880.000	2,064,096,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	260,300	5,225.000	1,360,067,500.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	71,100	10,725.000	762,547,500.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	143,900	6,425.000	924,557,500.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	240,800	2,640.000	635,712,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	665,700	1,430.000	951,951,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	2,120,400	10,150.000	21,522,060,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	1,442,400	7,400.000	10,673,760,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	599,600	5,800.000	3,477,680,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	2,614,900	5,975.000	15,624,027,500.00	
SARANA MENARA NUSANTARA PT	878,600	865.000	759,989,000.00		
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	1,927,000	3,970.000	7,650,190,000.00		
	インドネシア・ルピア小計	45,773,172		81,098,479,625.00 (778,545,403)	
ブラジル・ リアル	COSAN SA	42,588	16.420	699,294.96	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	140,800	36.670	5,163,136.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	180,200	36.320	6,544,864.00	
	PRIO SA	30,400	47.800	1,453,120.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	26,800	28.500	763,800.00	

CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	20,900	15.260	318,934.00	
GERDAU SA-PREF	42,440	20.780	881,903.20	
SUZANO SA	31,215	60.800	1,897,872.00	
VALE SA	129,788	59.760	7,756,130.88	
WEG SA	65,360	38.000	2,483,680.00	
CCR SA	32,700	14.000	457,800.00	
LOCALIZA RENT A CAR	35,730	52.800	1,886,544.00	
RUMO SA	47,600	22.060	1,050,056.00	
LOJAS RENNER S.A.	40,558	15.400	624,593.20	
MAGAZINE LUIZA SA	110,400	1.960	216,384.00	
VIBRA ENERGIA SA	44,080	25.290	1,114,783.20	
ATACADA0 SA	19,900	12.400	246,760.00	
RAIA DROGASIL SA	51,280	27.000	1,384,560.00	
SENDAS DISTRIBUIDORA SA	55,700	14.630	814,891.00	
AMBEV SA	183,800	12.630	2,321,394.00	
JBS SA	29,700	23.250	690,525.00	
NATURA &CO HOLDING SA	38,000	18.160	690,080.00	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	174,519	3.820	666,662.58	
REDE D'OR SAO LUIZ SA	20,200	25.220	509,444.00	
HYPERA SA	13,000	34.100	443,300.00	
BANCO BRADESCO S.A.	59,481	12.530	745,296.93	
BANCO BRADESCO SA-PREF	205,736	14.110	2,902,934.96	
BANCO DO BRASIL S.A.	31,100	57.290	1,781,719.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	183,400	34.540	6,334,636.00	
ITAUSA SA	211,580	10.660	2,255,442.80	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	216,300	12.330	2,666,979.00	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	26,200	33.270	871,674.00	
CAIXA SEGURIDADE PARTICIPACO	27,300	16.150	440,895.00	
TOTVS SA	18,400	30.990	570,216.00	
TELEFONICA BRASIL S.A.	16,800	52.020	873,936.00	
TIM SA	29,400	18.620	547,428.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	47,305	43.000	2,034,115.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	8,000	47.510	380,080.00	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	52,699	11.430	602,349.57	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	12,800	76.500	979,200.00	
COMPANHIA PARANAENSE -PREF B	34,000	9.870	335,580.00	
CPFL ENERGIA SA	7,300	33.380	243,674.00	
ENEVA SA	26,200	12.850	336,670.00	
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	6,450	40.150	258,967.50	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	37,800	33.450	1,264,410.00	
ブラジル・リアル小計	2,865,909		67,506,715.78 (2,016,081,316)	
チェコ・コ	KOMERCNI BANKA AS	2,663	816.500	2,174,339.50
ルナ	MONETA MONEY BANK AS	12,093	98.000	1,185,114.00

	CEZ AS	6,382	871.000	5,558,722.00	
	チェコ・コロナ小計	21,138		8,918,175.50 (57,669,382)	
韓国・ウォ ン	HD HYUNDAI	1,340	70,500.000	94,470,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	2,157	120,000.000	258,840,000.00	
	S-OIL CORP	1,775	79,300.000	140,757,500.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	3,543	27,450.000	97,255,350.00	
	HYUNDAI STEEL CO	2,767	33,100.000	91,587,700.00	
	KOREA ZINC CO LTD	285	450,500.000	128,392,500.00	
	KUM YANG CO LTD	1,245	126,400.000	157,368,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	531	139,700.000	74,180,700.00	
	LG CHEM LTD	1,909	431,000.000	822,779,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	227	297,500.000	67,532,500.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	723	121,300.000	87,699,900.00	
	POSCO HOLDINGS INC	2,761	435,000.000	1,201,035,000.00	
	SKC CO LTD	496	114,700.000	56,891,200.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	2,210	50,800.000	112,268,000.00	
	DOOSAN ENERBILITY CO LTD	16,971	17,980.000	305,138,580.00	
	ECOPRO BM CO LTD	1,920	256,500.000	492,480,000.00	
	ECOPRO CO LTD	786	601,000.000	472,386,000.00	
	ECOPRO MATERIALS CO LTD	616	150,200.000	92,523,200.00	
	GS HOLDINGS	2,131	49,400.000	105,271,400.00	
	HANWHA AEROSPACE CO LTD	1,363	180,100.000	245,476,300.00	
	HANWHA OCEAN CO LTD	3,632	27,000.000	98,064,000.00	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	830	117,100.000	97,193,000.00	
	HD KOREA SHIPBUILDING & OFFS	1,607	123,800.000	198,946,600.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	2,816	34,500.000	97,152,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	3,106	51,100.000	158,716,600.00	
	L&F CO LTD	1,068	162,200.000	173,229,600.00	
	LG CORP	3,469	94,900.000	329,208,100.00	
	LG ENERGY SOLUTION	1,816	398,500.000	723,676,000.00	
	POSCO FUTURE M CO LTD	1,173	316,500.000	371,254,500.00	
	POSCO INTERNATIONAL CORP	1,697	57,100.000	96,898,700.00	
	SAMSUNG C&T CORP	3,161	154,100.000	487,110,100.00	
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	5,041	25,700.000	129,553,700.00	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	27,200	8,850.000	240,720,000.00	
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	960	72,600.000	69,696,000.00		
SK INC	1,385	187,300.000	259,410,500.00		
SK SQUARE CO LTD	3,944	68,600.000	270,558,400.00		
HANJIN KAL CORP	1,262	59,100.000	74,584,200.00		
HMM CO LTD	7,862	15,960.000	125,477,520.00		
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	741	189,200.000	140,197,200.00		
KOREAN AIR LINES CO LTD	6,388	22,150.000	141,494,200.00		
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	2,945	52,400.000	154,318,000.00		

HANON SYSTEMS	8,177	6,000.000	49,062,000.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	2,378	269,000.000	639,682,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	5,276	243,500.000	1,284,706,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	1,296	157,700.000	204,379,200.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	913	158,000.000	144,254,000.00	
KIA CORP	10,042	125,000.000	1,255,250,000.00	
COWAY CO LTD	1,996	55,800.000	111,376,800.00	
LG ELECTRONICS INC	3,852	98,900.000	380,962,800.00	
KANGWON LAND INC	3,691	16,600.000	61,270,600.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	261	287,500.000	75,037,500.00	
KT&G CORP	3,799	92,600.000	351,787,400.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	694	94,300.000	65,444,200.00	
AMOREPACIFIC CORP	1,133	113,100.000	128,142,300.00	
LG H&H	359	345,500.000	124,034,500.00	
HLB INC	4,671	102,400.000	478,310,400.00	
CELLTRION INC	5,656	180,800.000	1,022,604,800.00	
CELLTRION PHARM INC	857	107,800.000	92,384,600.00	
HANMI PHARM CO LTD	246	321,500.000	79,089,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	696	826,000.000	574,896,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	1,033	93,900.000	96,998,700.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	902	60,500.000	54,571,000.00	
YUHAN CORP	2,048	74,000.000	151,552,000.00	
HANA FINANCIAL GROUP	10,681	62,100.000	663,290,100.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	11,154	15,250.000	170,098,500.00	
KAKAOBANK CORP	6,317	28,400.000	179,402,800.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	14,794	76,200.000	1,127,302,800.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	16,911	49,600.000	838,785,600.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	22,480	15,230.000	342,370,400.00	
KAKAOPAY CORP	839	39,950.000	33,518,050.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	1,369	70,000.000	95,830,000.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	3,907	83,200.000	325,062,400.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	8,457	8,020.000	67,825,140.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	5,391	12,890.000	69,489,990.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	2,379	41,050.000	97,657,950.00	
DB INSURANCE CO LTD	1,789	101,900.000	182,299,100.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	1,227	309,500.000	379,756,500.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	3,201	99,100.000	317,219,100.00	
POSCO DX CO LTD	1,864	54,300.000	101,215,200.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	1,448	157,700.000	228,349,600.00	
COSMOAM&T CO LTD	821	177,200.000	145,481,200.00	
LG DISPLAY CO LTD	11,601	11,180.000	129,699,180.00	
LG INNOTEK CO LTD	495	188,300.000	93,208,500.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	2,067	145,600.000	300,955,200.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	180,755	72,300.000	13,068,586,500.00	

	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	31,435	62,000.000	1,948,970,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	2,082	425,000.000	884,850,000.00	
	HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	1,522	96,200.000	146,416,400.00	
	SK HYNIX INC	20,778	161,200.000	3,349,413,600.00	
	KT CORP	2,098	38,250.000	80,248,500.00	
	LG UPLUS CORP	6,942	10,060.000	69,836,520.00	
	SK TELECOM	2,212	53,100.000	117,457,200.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	9,785	24,850.000	243,157,250.00	
	HYBE CO LTD	801	199,000.000	159,399,000.00	
	KAKAO CORP	12,106	54,100.000	654,934,600.00	
	KRAFTON INC	1,009	230,500.000	232,574,500.00	
	NAVER CORP	5,005	186,100.000	931,430,500.00	
	NCSOFT CORP	485	194,600.000	94,381,000.00	
	NETMARBLE CORP	678	59,100.000	40,069,800.00	
	韓国・ウォン小計	594,720		44,878,130,230.00 (5,039,814,025)	
マレーシ ア・リン ギット	PETRONAS DAGANGAN BHD	10,400	21.300	221,520.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	105,000	6.900	724,500.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	140,100	4.710	659,871.00	
	GAMUDA BHD	84,800	5.100	432,480.00	
	SIME DARBY BERHAD	93,800	2.680	251,384.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	30,900	9.400	290,460.00	
	MISC BHD	42,800	7.450	318,860.00	
	GENTING BHD	78,200	5.000	391,000.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	124,300	2.900	360,470.00	
	MR DIY GROUP M BHD	136,150	1.470	200,140.50	
	IOI CORP BHD	101,000	4.000	404,000.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	21,300	22.000	468,600.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	2,300	119.400	274,620.00	
	PPB GROUP BERHAD	20,240	15.420	312,100.80	
	QL RESOURCES BHD	29,250	5.930	173,452.50	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	80,400	4.340	348,936.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	85,700	6.080	521,056.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	68,900	4.100	282,490.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	252,100	6.610	1,666,381.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	22,700	19.360	439,472.00	
	MALAYAN BANKING BHD	212,100	9.710	2,059,491.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	565,400	4.270	2,414,258.00	
	RHB BANK BHD	48,000	5.620	269,760.00	
	INARI AMERTRON BHD	92,100	3.090	284,589.00	
AXIATA GROUP BERHAD	89,500	2.820	252,390.00		
CELCOMDIGI BHD	123,800	4.410	545,958.00		
MAXIS BHD	85,300	3.570	304,521.00		
TELEKOM MALAYSIA BHD	34,000	6.500	221,000.00		

	PETRONAS GAS BHD	30,700	17.800	546,460.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	104,400	11.600	1,211,040.00	
	YTL CORP BHD	149,000	2.610	388,890.00	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	108,600	3.680	399,648.00	
	マレーシア・リンギット小計	3,173,240		17,639,798.80 (558,550,116)	
南アフリ カ・ランド	EXXARO RESOURCES LTD	7,716	160.210	1,236,180.36	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	2,321	739.160	1,715,590.36	
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	15,268	420.450	6,419,430.60	
	GOLD FIELDS LTD	34,879	272.020	9,487,785.58	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	23,472	141.630	3,324,339.36	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	32,232	78.130	2,518,286.16	
	KUMBA IRON ORE LTD	2,544	410.700	1,044,820.80	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	14,047	116.380	1,634,789.86	
	SASOL LTD	20,736	135.870	2,817,400.32	
	SIBANYE STILLWATER LTD	119,878	20.990	2,516,239.22	
	BIDVEST GROUP LTD	11,039	249.320	2,752,243.48	
	NASPERS LTD-N SHS	7,012	3,057.630	21,440,101.56	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	70,079	19.020	1,332,902.58	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	32,847	59.760	1,962,936.72	
	BID CORP LTD	12,198	452.830	5,523,620.34	
	CLICKS GROUP LTD	9,867	300.080	2,960,889.36	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	18,303	253.120	4,632,855.36	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	15,681	210.500	3,300,850.50	
	ABSA GROUP LTD	32,536	153.070	4,980,285.52	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,296	2,088.310	6,883,069.76	
	NEDBANK GROUP LTD	16,626	222.410	3,697,788.66	
	STANDARD BANK GROUP LTD	50,740	186.300	9,452,862.00	
	FIRSTRAND LTD	191,077	63.430	12,120,014.11	
	REINET INVESTMENTS SCA	4,918	466.220	2,292,869.96	
	REMGRO LTD	19,028	141.350	2,689,607.80	
	DISCOVERY LTD	18,855	133.360	2,514,502.80	
	OLD MUTUAL LTD	170,915	11.820	2,020,215.30	
	OUTSURANCE GROUP LTD	26,578	38.710	1,028,834.38	
SANLAM LTD	70,266	70.900	4,981,859.40		
MTN GROUP LTD	67,043	86.290	5,785,140.47		
VODACOM GROUP LTD	21,750	93.880	2,041,890.00		
NEPI ROCKCASTLE N.V.	23,182	129.310	2,997,664.42		
	南アフリカ・ランド小計	1,166,929		140,107,867.10 (1,115,258,622)	
タイ・バー ツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	52,600	153.500	8,074,100.00	
	PTT PCL-NVDR	391,900	34.750	13,618,525.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	52,500	59.000	3,097,500.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	54,400	24.900	1,354,560.00	

PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	78,600	40.000	3,144,000.00		
SCG PACKAGING PCL-NVDR	41,600	29.500	1,227,200.00		
SIAM CEMENT PCL-NVDR	31,300	270.000	8,451,000.00		
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	154,600	66.500	10,280,900.00		
BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR	348,900	8.400	2,930,760.00		
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	229,500	5.300	1,216,350.00		
ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	184,500	3.920	723,240.00		
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	126,300	33.000	4,167,900.00		
CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	63,391	36.250	2,297,923.75		
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	235,400	11.100	2,612,940.00		
PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	110,600	18.200	2,012,920.00		
CP ALL PCL-NVDR	229,200	56.250	12,892,500.00		
CP AXTRA PCL-NVDR	77,100	32.750	2,525,025.00		
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	154,600	18.400	2,844,640.00		
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	433,400	29.000	12,568,600.00		
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	22,300	227.000	5,062,100.00		
KASIKORNBANK PCL-NVDR	23,700	125.000	2,962,500.00		
KRUNG THAI BANK - NVDR	103,500	16.100	1,666,350.00		
SCB X PCL-NVDR	30,600	114.000	3,488,400.00		
TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	1,077,800	1.810	1,950,818.00		
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	50,200	44.750	2,246,450.00		
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	38,500	46.500	1,790,250.00		
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	112,100	66.500	7,454,650.00		
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	43,600	206.000	8,981,600.00		
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	35,900	70.000	2,513,000.00		
TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	333,267	7.900	2,632,809.30		
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	57,500	35.500	2,041,250.00		
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	27,400	54.000	1,479,600.00		
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	99,400	45.500	4,522,700.00		
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	76,200	63.500	4,838,700.00		
LAND & HOUSES PUB - NVDR	380,200	7.050	2,680,410.00		
タイ・パーツ小計	5,562,558		152,352,171.05 (632,261,510)		
ポーランド・ズロチ	ORLEN SA	22,272	64.050	1,426,521.60	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	4,782	118.450	566,427.90	
	BUDIMEX	546	671.000	366,366.00	
	LPP SA	39	11,450.000	446,550.00	
	ALLEGRO.EU SA	17,996	33.060	594,947.76	
	PEPCO GROUP NV	5,020	17.990	90,309.80	
	DINO POLSKA SA	1,969	416.700	820,482.30	
	BANK PEKAO SA	6,831	174.300	1,190,643.30	
	MBANK SA	477	723.800	345,252.60	
	PKO BANK POLSKI SA	34,078	55.320	1,885,194.96	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	1,451	535.500	777,010.50	

	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	23,952	47.500	1,137,720.00	
	PGE SA	36,813	7.250	266,894.25	
	CD PROJEKT SA	2,415	116.150	280,502.25	
	ポーランド・ズロチ小計	158,641		10,194,823.22 (385,067,647)	
ハンガリー・フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	18,299	2,928.000	53,579,472.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	5,283	9,315.000	49,211,145.00	
	OTP BANK PLC	8,272	16,785.000	138,845,520.00	
	ハンガリー・フォリント小計	31,854		241,636,137.00 (100,053,549)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	2,780	26.980	75,004.40	
	MYTILINEOS S.A.	3,556	36.500	129,794.00	
	FF GROUP	123	4.800	590.40	
	OPAP SA	6,174	16.820	103,846.68	
	JUMBO SA	4,834	26.700	129,067.80	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	91,747	1.705	156,428.63	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	97,148	1.783	173,214.88	
	NATIONAL BANK OF GREECE	28,414	7.220	205,149.08	
	PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS S	40,213	3.930	158,037.09	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	6,284	13.690	86,027.96	
	PUBLIC POWER CORP	8,551	11.700	100,046.70	
	ユーロ小計	289,824		1,317,207.62 (214,151,615)	
	合計	125,643,924		35,337,370,028 (35,337,370,028)	

(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	19銘柄	2.4%	3.0%
香港・ドル	株式	168銘柄	17.6%	21.6%
台湾・ドル	株式	89銘柄	16.2%	19.9%
エジプト・ポンド	株式	3銘柄	0.1%	0.1%
トルコ・リラ	株式	17銘柄	0.6%	0.8%
メキシコ・ペソ	株式	19銘柄	1.8%	2.2%
フィリピン・ペソ	株式	14銘柄	0.6%	0.7%
チリ・ペソ	株式	12銘柄	0.5%	0.6%
コロンビア・ペソ	株式	3銘柄	0.1%	0.1%
インド・ルピー	株式	136銘柄	16.4%	20.2%
インドネシア・ルピア	株式	22銘柄	1.8%	2.2%
ブラジル・レアル	株式	45銘柄	4.6%	5.7%
チェコ・コルナ	株式	3銘柄	0.1%	0.2%
韓国・ウォン	株式	99銘柄	11.6%	14.3%
マレーシア・リングgit	株式	32銘柄	1.3%	1.6%
南アフリカ・ランド	株式	32銘柄	2.6%	3.2%
タイ・バーツ	株式	35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	11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	2,316,000.00	84,904,560.00	
		オフショア・人民元小計	2,316,000.00	84,904,560.00 (1,758,891,355)	
投資信託受益証券合計				1,758,891,355 (1,758,891,355)	
投資証券	アメリカ・ドル	ISHARES MSCI KUWAIT ETF	66,766.00	2,249,880.66	
		ISHARES MSCI QATAR ETF	130,666.00	2,349,636.01	
		ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	262,425.00	11,675,288.25	
		ISHARES MSCI UAE ETF	229,677.00	3,364,768.05	
	アメリカ・ドル小計		689,534.00	19,639,572.97 (2,932,581,036)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB-CPO	574,800.00	8,156,412.00	
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	20,875.00	3,428,927.50	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	73,600.00	15,765,120.00	
		PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	24,860.00	1,767,794.60	
		TRUST FIBRA UNO	117,000.00	3,311,100.00	
	メキシコ・ペソ小計		811,135.00	32,429,354.10 (289,863,296)	
	ブラジル・リアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	42,700.00	1,548,729.00	
		BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	13,100.00	376,494.00	
		ENERGISA SA-UNITS	11,000.00	525,360.00	
		KLABIN SA - UNIT	31,300.00	728,977.00	
	ブラジル・リアル小計		98,100.00	3,179,560.00 (94,957,241)	
投資証券合計				3,317,401,573 (3,317,401,573)	
合計				5,076,292,928 (5,076,292,928)	

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 4銘柄	-	6.7%	57.8%
メキシコ・ペソ	投資証券 5銘柄	-	0.7%	5.7%
ブラジル・リアル	投資証券 4銘柄	-	0.2%	1.9%
オフショア・人民元	投資信託受益証券 1銘柄	4.0%	-	34.6%

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。

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3月18日現在)	
資産の部	
流動資産	
金銭信託	13,348,358
コール・ローン	498,006,592
国債証券	105,774,277,260
地方債証券	8,608,486,800
特殊債券	10,443,737,254
社債券	7,064,444,700
未収入金	104,871,300
未収利息	385,065,163
前払費用	20,043,143
流動資産合計	132,912,280,570
資産合計	132,912,280,570
負債の部	
流動負債	
未払金	103,871,700
未払解約金	205,304,037
その他未払費用	609
流動負債合計	309,176,346
負債合計	309,176,346
純資産の部	
元本等	
元本	109,512,290,248
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	23,090,813,976
元本等合計	132,603,104,224
純資産合計	132,603,104,224
負債純資産合計	132,912,280,570

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2023年3月24日 至 2024年3月18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</p> <p>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券</p> <p>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
--	---

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項 目	（2024年3月18日現在）
1. 当計算期間の末日における 受益権の総数	109,512,290,248口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2109円 （1万口当たりの純資産額12,109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3月24日 至 2024年3月18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3月18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、地方債証券、特殊債券、社債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2023年3月24日 至 2024年3月18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3月18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	98,535,915,219円
同期中における追加設定元本額	31,966,977,142円
同期中における一部解約元本額	20,990,602,113円
2024年3月18日現在の元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	9,772,347,384円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	15,714,274,054円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	4,104,212,009円
S M A M ・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	939,855,555円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	43,075,854円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	194,236,574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)	638,153,034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)	1,275,458,249円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	712,443,679円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	874,776,765円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	139,053,232円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	823,554,467円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	244,972,210円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	13,534,979円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2050	112,071,391円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	5,058,102,646円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,746,637,270円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	2,905,110,020円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	702,979,420円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	77,062,937円
三井住友・DCつみたてN I S A ・世界分散ファンド	327,473,798円
三井住友D S ・年金バランス30(債券重点型)	414,761,670円
三井住友D S ・年金バランス50(標準型)	928,833,470円
三井住友D S ・年金バランス70(株式重点型)	306,092,130円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2060	11,715,363円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2035	78,799,724円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2040	35,230,147円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2045	28,111,067円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2055	3,676,552円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2065	2,135,632円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	7,183,699円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	48,227,383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)	142,958,651円

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	49,413,167円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	5,268,596円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	1,031,782,182円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	8,457,855,330円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	5,886,694,559円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	15,391,388,506円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	306,375,000円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	497,670,273円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	274,074,334円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	118,270,332円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,732,178,254円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,201,314,761円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,138,773,236円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	7,472,985,319円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	934,554,756円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	370,979,799円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	448,136,826円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	180,473,962円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	51,549,601円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,121,752,777円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	1,953,339,453円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	569,310,953円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	220,775,391円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	25,746,829円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	247,758,985円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	4,568,171,763円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	1,212,786,710円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	772,470,672円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	1,232,425,839円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	902,525,395円
SMDAM・年金Wリスクコントロールファンド(リスク3%)<適格機関投資家限定>	708,375,673円
合計	109,512,290,248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	453 2年国債	400,000,000	399,232,000	
	454 2年国債	60,000,000	59,961,000	
	455 2年国債	1,030,000,000	1,027,373,500	
	456 2年国債	230,000,000	229,733,200	

4 5 7	2年国債	500,000,000	499,295,000	
4 5 8	2年国債	50,000,000	50,019,000	
1 4 5	5年国債	1,180,000,000	1,179,634,200	
1 4 6	5年国債	1,000,000,000	999,030,000	
1 4 7	5年国債	1,310,000,000	1,305,677,000	
1 4 8	5年国債	1,180,000,000	1,175,362,600	
1 4 9	5年国債	1,290,000,000	1,284,040,200	
1 5 0	5年国債	3,130,000,000	3,113,692,700	
1 5 1	5年国債	300,000,000	298,251,000	
1 5 2	5年国債	730,000,000	727,817,300	
1 5 3	5年国債	1,200,000,000	1,191,852,000	
1 5 4	5年国債	1,180,000,000	1,174,253,400	
1 5 6	5年国債	1,280,000,000	1,276,902,400	
1 5 7	5年国債	370,000,000	368,679,100	
1 5 8	5年国債	930,000,000	923,006,400	
1 5 9	5年国債	100,000,000	99,118,000	
1 6 0	5年国債	1,190,000,000	1,184,502,200	
1 6 1	5年国債	370,000,000	369,844,600	
1 6 2	5年国債	220,000,000	219,608,400	
1 6 3	5年国債	770,000,000	771,878,800	
1 6 4	5年国債	280,000,000	277,838,400	
1 6 5	5年国債	1,420,000,000	1,415,683,200	
1	40年国債	40,000,000	46,028,400	
2	40年国債	242,000,000	268,409,460	
3	40年国債	185,000,000	204,443,500	
4	40年国債	247,000,000	272,631,190	
5	40年国債	235,000,000	248,608,850	
6	40年国債	240,000,000	247,879,200	
7	40年国債	265,000,000	260,343,950	
8	40年国債	300,000,000	272,862,000	
9	40年国債	523,000,000	346,199,850	
1 0	40年国債	470,000,000	365,039,600	
1 1	40年国債	370,000,000	275,672,200	
1 2	40年国債	390,000,000	257,364,900	
1 3	40年国債	515,000,000	335,404,050	
1 4	40年国債	505,000,000	350,126,600	
1 5	40年国債	560,000,000	427,543,200	
1 6	40年国債	500,000,000	417,815,000	
3 4 0	10年国債	770,000,000	773,241,700	
3 4 1	10年国債	557,000,000	558,409,210	
3 4 2	10年国債	350,000,000	349,510,000	
3 4 3	10年国債	310,000,000	309,442,000	
3 4 4	10年国債	811,000,000	809,175,250	
3 4 5	10年国債	258,000,000	257,326,620	
3 4 6	10年国債	340,000,000	338,983,400	

3 4 7	10年国債	100,000,000	99,628,000	
3 4 8	10年国債	145,000,000	144,293,850	
3 4 9	10年国債	650,000,000	646,009,000	
3 5 0	10年国債	510,000,000	506,164,800	
3 5 1	10年国債	350,000,000	346,913,000	
3 5 2	10年国債	150,000,000	148,401,000	
3 5 3	10年国債	180,000,000	177,811,200	
3 5 4	10年国債	565,000,000	557,366,850	
3 5 5	10年国債	660,000,000	650,311,200	
3 5 6	10年国債	130,000,000	127,966,800	
3 5 7	10年国債	710,000,000	698,206,900	
3 5 8	10年国債	1,010,000,000	991,648,300	
3 5 9	10年国債	1,130,000,000	1,107,614,700	
3 6 0	10年国債	1,150,000,000	1,124,907,000	
3 6 1	10年国債	1,160,000,000	1,131,893,200	
3 6 2	10年国債	1,030,000,000	1,002,457,800	
3 6 3	10年国債	1,030,000,000	999,748,900	
3 6 4	10年国債	710,000,000	686,960,500	
3 6 5	10年国債	1,040,000,000	1,003,319,200	
3 6 6	10年国債	1,170,000,000	1,134,689,400	
3 6 7	10年国債	1,110,000,000	1,073,381,100	
3 6 8	10年国債	1,190,000,000	1,147,755,000	
3 6 9	10年国債	1,110,000,000	1,095,747,600	
3 7 0	10年国債	970,000,000	955,585,800	
3 7 1	10年国債	1,010,000,000	983,659,200	
3 7 2	10年国債	970,000,000	977,333,200	
3 7 3	10年国債	970,000,000	956,332,700	
2	30年国債	440,000,000	491,506,400	
4	30年国債	340,000,000	394,610,800	
5	30年国債	290,000,000	324,684,000	
7	30年国債	474,000,000	538,222,260	
9	30年国債	240,000,000	255,228,000	
1 0	30年国債	95,000,000	98,552,050	
1 1	30年国債	430,000,000	468,798,900	
1 2	30年国債	570,000,000	642,276,000	
1 4	30年国債	392,000,000	453,234,320	
1 6	30年国債	205,000,000	239,706,500	
1 8	30年国債	190,000,000	218,709,000	
1 9	30年国債	170,000,000	195,823,000	
2 1	30年国債	345,000,000	398,040,300	
2 2	30年国債	315,000,000	370,597,500	
2 3	30年国債	349,000,000	411,083,610	
2 4	30年国債	460,000,000	542,123,800	
2 5	30年国債	260,000,000	300,445,600	
2 6	30年国債	253,000,000	295,283,890	

27	30年国債	250,000,000	294,972,500	
28	30年国債	96,000,000	113,269,440	
29	30年国債	157,000,000	183,220,570	
30	30年国債	142,000,000	163,626,600	
31	30年国債	235,000,000	267,119,800	
32	30年国債	360,000,000	413,992,800	
33	30年国債	208,000,000	229,344,960	
34	30年国債	87,000,000	98,382,210	
35	30年国債	260,000,000	285,344,800	
36	30年国債	90,000,000	98,614,800	
37	30年国債	225,000,000	242,426,250	
38	30年国債	220,000,000	232,683,000	
39	30年国債	220,000,000	235,787,200	
40	30年国債	260,000,000	273,837,200	
41	30年国債	240,000,000	248,260,800	
42	30年国債	280,000,000	289,060,800	
43	30年国債	265,000,000	273,230,900	
44	30年国債	310,000,000	319,222,500	
45	30年国債	315,000,000	313,015,500	
46	30年国債	315,000,000	312,502,050	
47	30年国債	290,000,000	292,552,000	
48	30年国債	400,000,000	388,440,000	
49	30年国債	345,000,000	334,401,600	
50	30年国債	325,000,000	278,161,000	
51	30年国債	345,000,000	262,144,800	
52	30年国債	363,000,000	288,102,210	
53	30年国債	297,000,000	240,433,380	
54	30年国債	115,000,000	97,161,200	
55	30年国債	355,000,000	298,760,900	
56	30年国債	320,000,000	268,470,400	
57	30年国債	295,000,000	246,729,150	
58	30年国債	350,000,000	291,823,000	
59	30年国債	390,000,000	316,496,700	
60	30年国債	380,000,000	322,388,200	
61	30年国債	345,000,000	277,866,450	
62	30年国債	275,000,000	209,561,000	
63	30年国債	230,000,000	169,673,300	
64	30年国債	315,000,000	231,433,650	
65	30年国債	275,000,000	201,399,000	
66	30年国債	360,000,000	262,137,600	
67	30年国債	340,000,000	260,746,000	
68	30年国債	360,000,000	275,072,400	
69	30年国債	350,000,000	274,281,000	
70	30年国債	370,000,000	288,955,200	
71	30年国債	350,000,000	272,380,500	

7 2	3 0 年国債	370,000,000	286,938,700	
7 3	3 0 年国債	380,000,000	293,926,200	
7 4	3 0 年国債	340,000,000	284,586,800	
7 5	3 0 年国債	360,000,000	324,460,800	
7 6	3 0 年国債	370,000,000	341,151,100	
7 7	3 0 年国債	350,000,000	338,016,000	
7 8	3 0 年国債	400,000,000	367,756,000	
7 9	3 0 年国債	320,000,000	279,721,600	
8 0	3 0 年国債	360,000,000	362,793,600	
8 1	3 0 年国債	310,000,000	297,407,800	
8 2	2 0 年国債	620,000,000	638,463,600	
8 4	2 0 年国債	500,000,000	516,155,000	
8 5	2 0 年国債	645,000,000	669,909,900	
8 8	2 0 年国債	742,000,000	777,408,240	
8 9	2 0 年国債	20,000,000	20,909,600	
9 0	2 0 年国債	580,000,000	609,156,600	
9 2	2 0 年国債	324,000,000	340,964,640	
9 3	2 0 年国債	632,000,000	666,052,160	
9 5	2 0 年国債	305,000,000	325,605,800	
9 7	2 0 年国債	327,000,000	349,347,180	
9 9	2 0 年国債	153,000,000	163,471,320	
1 0 0	2 0 年国債	207,000,000	222,732,000	
1 0 1	2 0 年国債	355,000,000	384,788,050	
1 0 2	2 0 年国債	457,000,000	497,316,540	
1 0 5	2 0 年国債	370,000,000	399,082,000	
1 0 6	2 0 年国債	370,000,000	400,724,800	
1 0 7	2 0 年国債	378,000,000	408,946,860	
1 0 9	2 0 年国債	40,000,000	43,026,800	
1 1 1	2 0 年国債	386,000,000	422,407,520	
1 1 3	2 0 年国債	27,000,000	29,520,720	
1 1 4	2 0 年国債	163,000,000	178,841,970	
1 1 8	2 0 年国債	200,000,000	219,458,000	
1 1 9	2 0 年国債	295,000,000	320,101,550	
1 2 0	2 0 年国債	200,000,000	214,514,000	
1 2 1	2 0 年国債	55,000,000	60,136,450	
1 2 2	2 0 年国債	130,000,000	141,317,800	
1 2 3	2 0 年国債	70,000,000	77,598,500	
1 2 5	2 0 年国債	205,000,000	229,120,300	
1 2 6	2 0 年国債	180,000,000	198,669,600	
1 2 7	2 0 年国債	145,000,000	159,056,300	
1 2 8	2 0 年国債	65,000,000	71,420,700	
1 3 0	2 0 年国債	155,000,000	169,332,850	
1 3 1	2 0 年国債	80,000,000	86,820,000	
1 3 2	2 0 年国債	450,000,000	488,677,500	
1 3 3	2 0 年国債	190,000,000	207,744,100	

134	20年国債	200,000,000	218,994,000	
135	20年国債	155,000,000	168,469,500	
136	20年国債	120,000,000	129,508,800	
137	20年国債	185,000,000	201,243,000	
139	20年国債	60,000,000	64,770,000	
140	20年国債	420,000,000	457,207,800	
141	20年国債	360,000,000	391,964,400	
142	20年国債	240,000,000	263,409,600	
143	20年国債	150,000,000	162,187,500	
144	20年国債	170,000,000	182,289,300	
145	20年国債	110,000,000	119,925,300	
146	20年国債	195,000,000	212,569,500	
147	20年国債	840,000,000	906,964,800	
148	20年国債	459,000,000	491,029,020	
149	20年国債	625,000,000	668,362,500	
150	20年国債	571,000,000	604,494,860	
151	20年国債	700,000,000	725,928,000	
152	20年国債	520,000,000	538,579,600	
153	20年国債	587,000,000	613,503,050	
154	20年国債	650,000,000	671,378,500	
155	20年国債	510,000,000	514,600,200	
156	20年国債	270,000,000	253,451,700	
157	20年国債	385,000,000	351,181,600	
158	20年国債	380,000,000	358,476,800	
159	20年国債	388,000,000	369,395,400	
160	20年国債	445,000,000	427,422,500	
161	20年国債	610,000,000	576,382,900	
162	20年国債	470,000,000	442,364,000	
163	20年国債	520,000,000	487,474,000	
164	20年国債	505,000,000	465,130,250	
165	20年国債	600,000,000	550,212,000	
166	20年国債	495,000,000	465,280,200	
167	20年国債	530,000,000	481,976,700	
168	20年国債	520,000,000	463,866,000	
169	20年国債	480,000,000	419,428,800	
170	20年国債	515,000,000	447,668,900	
171	20年国債	475,000,000	410,732,500	
172	20年国債	480,000,000	419,990,400	
173	20年国債	485,000,000	422,173,100	
174	20年国債	700,000,000	606,137,000	
175	20年国債	655,000,000	574,205,750	
176	20年国債	670,000,000	584,776,000	
177	20年国債	670,000,000	571,717,700	
178	20年国債	650,000,000	561,814,500	
179	20年国債	690,000,000	594,083,100	

	180	20年国債	550,000,000	497,893,000	
	181	20年国債	530,000,000	486,518,800	
	182	20年国債	550,000,000	521,147,000	
	183	20年国債	540,000,000	536,409,000	
	184	20年国債	590,000,000	555,508,600	
	185	20年国債	590,000,000	553,496,700	
	186	20年国債	480,000,000	481,084,800	
	187	20年国債	390,000,000	376,677,600	
		国債証券 小計		105,774,277,260	
地方債証券	1	東京都30年	100,000,000	112,327,300	
	8	東京都30年	400,000,000	450,450,400	
	13	東京都30年	500,000,000	534,338,500	
	6	東京都20年	100,000,000	101,835,900	
	26-15	北海道公債	100,000,000	100,286,700	
	30-18	北海道公債	200,000,000	196,883,800	
	210	神奈川県公債	100,000,000	100,254,000	
	211	神奈川県公債	100,000,000	100,244,100	
	3	神奈川県20年	100,000,000	102,470,400	
	7	神奈川県20年	100,000,000	105,820,500	
	13	神奈川県20年	100,000,000	109,793,300	
	388	大阪府公債	100,000,000	100,246,100	
	392	大阪府公債	100,000,000	100,205,800	
	1	大阪府20年	200,000,000	218,615,000	
	179	大阪府5年	100,000,000	99,572,700	
	193	大阪府5年	300,000,000	297,545,400	
	27-4	京都府公債	100,000,000	100,513,400	
	29-4	京都府公債	100,000,000	99,689,500	
	1-6	京都府5年	200,000,000	199,924,000	
	5	兵庫県公債15年	300,000,000	311,542,800	
	10	兵庫県公債20年	100,000,000	110,209,000	
	7	静岡県30年	100,000,000	107,162,500	
	1	静岡県20年	100,000,000	102,983,800	
	22-8	愛知県20年	200,000,000	217,292,000	
	27-16	愛知県公債	400,000,000	401,631,200	
	2	埼玉県公債	300,000,000	298,439,400	
	5	埼玉県20年	100,000,000	107,857,800	
	26-10	福岡県公債	100,000,000	100,317,000	
	1-1	福岡県公債	200,000,000	195,412,000	
	1-3	福岡県30年	100,000,000	72,691,400	
	26-4	千葉県公債	100,000,000	100,246,200	
	27-3	千葉県公債	100,000,000	100,483,000	
	28-1	千葉県公債	100,000,000	99,632,500	
	9	千葉県20年	200,000,000	216,752,200	
	138	共同発行地方	200,000,000	200,492,400	
	155	共同発行地方	100,000,000	99,970,900	

	172 共同発行地方	500,000,000	498,826,000	
	183 共同発行地方	600,000,000	595,292,400	
	199 共同発行地方	100,000,000	97,636,800	
	3 名古屋市20年	100,000,000	102,371,200	
	5 名古屋市20年	100,000,000	105,088,400	
	1 京都市30年	100,000,000	117,506,000	
	7 京都市20年	100,000,000	108,756,700	
	26-17 神戸市公債	100,000,000	100,136,300	
	4 横浜市20年	100,000,000	101,904,700	
	7 横浜市20年	100,000,000	103,215,100	
	9 横浜市20年	100,000,000	104,715,500	
	14 横浜市20年	100,000,000	107,739,600	
	2-7 札幌市公債	100,000,000	97,083,000	
	94 川崎市公債	100,000,000	96,140,300	
	1-2 北九州市5年	100,000,000	99,960,900	
	1-2 岡山県公債	100,000,000	97,981,000	
	地方債証券 小計		8,608,486,800	
特殊債券	47 日本政策投資CO	100,000,000	102,644,000	
	124 日本政策投資	100,000,000	97,530,000	
	36 日本政策投資B	100,000,000	105,937,600	
	18 道路機構	100,000,000	121,168,000	
	22 道路機構	300,000,000	352,201,800	
	27 道路機構	100,000,000	106,908,300	
	37 道路機構	300,000,000	324,783,900	
	47 道路機構	200,000,000	218,843,200	
	135 道路機構	200,000,000	204,142,200	
	74 政保道路機構	100,000,000	107,080,200	
	79 政保道路機構	200,000,000	216,742,400	
	81 政保道路機構	200,000,000	217,007,800	
	88 政保道路機構	100,000,000	114,175,400	
	90 政保道路機構	500,000,000	545,085,500	
	99 政保道路機構	100,000,000	110,067,000	
	127 政保道路機構	200,000,000	219,711,800	
	176 政保道路機構	100,000,000	107,800,200	
	196 政保道路機構	100,000,000	109,075,100	
	210 政保道路機構	200,000,000	213,544,600	
	227 政保道路機構	200,000,000	200,492,000	
	231 政保道路機構	300,000,000	300,822,300	
	288 政保道路機構	189,000,000	187,796,637	
	9 道路債券	100,000,000	116,894,700	
	2 地方公営20年	100,000,000	108,324,600	
	4 地方公共団20年	100,000,000	108,343,300	
	18 地方公共団20	300,000,000	321,626,100	
	F96 地方公共団体	100,000,000	103,118,900	
	F143 地方公共団体	100,000,000	102,964,900	

6 4	地方公共団体	100,000,000	100,167,700	
6 7	政保地方公共団	100,000,000	100,264,100	
7 6	政保地方公共団	300,000,000	301,047,600	
8 5	地方公共団体	100,000,000	99,205,100	
1 0 1	地方公共団体	100,000,000	99,041,400	
1 0 6	地方公共団体	200,000,000	197,406,600	
2 9	地方公共団5年	300,000,000	296,956,500	
1 5	公営企業20年	100,000,000	102,687,000	
1 7	公営企業20年	100,000,000	103,945,200	
2 0	公営企業20年	100,000,000	105,383,200	
2 2	公営企業20年	100,000,000	105,996,000	
2 4	公営企業20年	200,000,000	214,121,600	
1 0	日本政策金融	100,000,000	109,465,500	
8 9	都市再生	100,000,000	102,816,600	
9 3	都市再生	100,000,000	102,909,900	
1 1 7	都市再生	100,000,000	101,220,500	
3 3	政保中部空港	200,000,000	199,226,000	
5 2	住宅支援機構	100,000,000	108,818,700	
9 3	住宅支援機構	100,000,000	103,303,200	
1 2 4	住宅支援機構	100,000,000	103,753,100	
1 3 0	住宅支援機構	200,000,000	215,888,600	
2 2 6	住宅支援機構	100,000,000	99,330,200	
S 7	住宅機構R M B S	9,585,000	9,591,709	
S 9	住宅機構R M B S	9,863,000	9,871,876	
S 1 0	住宅機構R M B S	9,732,000	9,739,785	
S 1 1	住宅機構R M B S	10,588,000	10,675,880	
2	住宅機構R M B S	18,866,000	18,882,979	
1 9	住宅機構R M B S	12,843,000	13,218,015	
2 4	住宅機構R M B S	25,942,000	26,811,057	
2 6	住宅機構R M B S	40,038,000	41,251,151	
2 7	住宅機構R M B S	14,457,000	14,962,995	
2 8	住宅機構R M B S	16,771,000	17,497,184	
2 9	住宅機構R M B S	18,171,000	18,997,780	
3 0	住宅機構R M B S	17,736,000	18,546,535	
3 2	住宅機構R M B S	35,284,000	36,691,831	
3 5	住宅機構R M B S	17,827,000	18,584,647	
3 6	住宅機構R M B S	17,064,000	17,727,789	
4 3	住宅機構R M B S	22,206,000	23,018,739	
4 6	住宅機構R M B S	17,047,000	17,706,718	
4 8	住宅機構R M B S	32,422,000	33,647,551	
4 9	住宅機構R M B S	16,586,000	17,168,168	
5 1	住宅機構R M B S	36,220,000	37,458,724	
5 5	住宅機構R M B S	48,430,000	49,824,784	
5 7	住宅機構R M B S	23,097,000	23,787,600	
5 8	住宅機構R M B S	25,855,000	26,604,795	

	5 9 住宅機構 R M B S	49,140,000	50,648,598	
	6 0 住宅機構 R M B S	74,580,000	76,548,912	
	6 1 住宅機構 R M B S	25,093,000	25,665,120	
	6 7 住宅機構 R M B S	32,245,000	32,602,919	
	6 9 住宅機構 R M B S	67,328,000	68,721,689	
	7 0 住宅機構 R M B S	58,364,000	59,642,171	
	7 3 住宅機構 R M B S	33,144,000	33,883,111	
	9 9 住宅機構 R M B S	52,325,000	51,827,912	
	1 2 3 住宅機構 R M B S	69,782,000	66,432,464	
	1 2 4 住宅機構 R M B S	69,391,000	65,845,119	
	1 2 5 住宅機構 R M B S	69,260,000	65,727,740	
	1 2 7 住宅機構 R M B S	71,444,000	67,550,302	
	1 2 8 住宅機構 R M B S	70,119,000	66,472,812	
	1 2 9 住宅機構 R M B S	71,752,000	68,114,173	
	1 3 7 住宅機構 R M B S	74,260,000	70,301,942	
	1 6 7 住宅機構 R M B S	86,593,000	80,548,808	
	1 8 3 住宅機構 R M B S	185,202,000	175,015,890	
	1 8 6 住宅機構 R M B S	94,163,000	90,754,299	
	1 9 8 住宅機構 R M B S	197,006,000	198,503,244	
	8 5 中日本高速道	300,000,000	298,875,000	
	特殊債券 小計		10,443,737,254	
社債券	8 6 東日本高速道	200,000,000	198,190,800	
	2 3 西日本高速道	100,000,000	100,154,900	
	8 4 西日本高速道	200,000,000	199,778,600	
	1 3 大和ハウス	100,000,000	99,374,600	
	1 7 アサヒグループHD	200,000,000	198,787,000	
	3 0 東レ	100,000,000	99,497,800	
	1 2 旭化成	200,000,000	195,115,600	
	2 4 三菱ケミカルホールデイ	100,000,000	98,998,600	
	3 2 住友電工	100,000,000	98,851,200	
	1 6 小松製作所	100,000,000	98,896,400	
	2 2 日立製作所	100,000,000	100,483,700	
	9 T D K	100,000,000	97,559,300	
	6 3 三井物産	100,000,000	105,885,600	
	8 みずほコーポレート	100,000,000	106,802,100	
	1 三井住友 F G 劣後	100,000,000	100,195,200	
	8 住友信託 劣後	100,000,000	105,380,500	
	1 みずほ F G 劣後	100,000,000	100,210,000	
	9 みずほ銀行劣後	100,000,000	105,577,700	
	1 7 N T T ファイナンス	200,000,000	197,785,400	
	7 3 ホンダファイナンス	200,000,000	198,166,600	
	1 0 1 トヨタファイナンス	200,000,000	200,089,000	
	2 0 7 オリックス	200,000,000	198,715,000	
	2 三菱HCキャピタル	200,000,000	198,010,400	
	5 8 三菱地所	100,000,000	115,274,400	

1 3 5	三菱地所	200,000,000	191,501,600	
1 0	東急	100,000,000	95,035,700	
3 8	京王電鉄	100,000,000	99,316,700	
1 1 0	東日本旅客鉄	100,000,000	98,924,900	
1 6 9	東日本旅客鉄	200,000,000	190,946,600	
6 0	西日本旅客鉄	200,000,000	194,727,000	
4 1	東海旅客鉄道	100,000,000	107,220,000	
4 2	東海旅客鉄道	100,000,000	108,201,000	
4 5	東京地下鉄	100,000,000	96,855,100	
6 4	阪急阪神H L D G	100,000,000	99,104,400	
1 5	九州旅客鉄道	200,000,000	198,619,400	
3 1	K D D I	200,000,000	199,177,600	
5 4 6	中部電力	200,000,000	191,231,600	
5 5 3	中部電力	200,000,000	199,004,200	
5 5 0	関西電力	300,000,000	299,040,900	
5 6 0	関西電力	200,000,000	203,894,400	
5 0 8	東北電力	200,000,000	197,469,600	
5 4 7	東北電力	100,000,000	98,803,400	
4 9 6	九州電力	300,000,000	286,407,300	
5 6	東京電力P G	200,000,000	201,420,400	
6 6	東京電力P G	100,000,000	98,906,700	
4 1	大阪瓦斯	200,000,000	191,739,800	
7	ファーストリテイリング	100,000,000	99,116,000	
	社債券 小計		7,064,444,700	
	合 計		131,890,946,014	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位 : 円)

(2024年3月18日現在)

資産の部

流動資産

預金	275,152,280
金銭信託	38,804,826
コール・ローン	1,447,748,000
国債証券	177,808,304,042
未収利息	1,333,671,003
前払費用	113,975,324
流動資産合計	181,017,655,475

資産合計

181,017,655,475

負債の部

流動負債

未払解約金	67,462,405
-------	------------

その他未払費用	1,991
流動負債合計	67,464,396
負債合計	67,464,396
純資産の部	
元本等	
元本	81,276,928,619
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	99,673,262,460
元本等合計	180,950,191,079
純資産合計	180,950,191,079
負債純資産合計	181,017,655,475

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2023年3月24日 至 2024年3月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項 目	(2024年3月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	81,276,928,619口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.2263円 (1万口当たりの純資産額22,263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3月24日 至 2024年3月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、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3月18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3月24日 至 2024年3月18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3月18日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	77,880,143,308円
同期中における追加設定元本額	13,878,113,165円
同期中における一部解約元本額	10,481,327,854円
2024年3月18日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	27,355,794,405円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	969,291,403円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,437,524,335円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,482,471,479円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	166,045,139円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	5,712,728円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	24,761,652円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	95,498,475円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	295,062,458円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	222,554,062円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	364,364,727円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	20,149,798円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	55,911,331円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	101,159,985円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	63,645,439円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	41,995,882円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	362,556,344円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	249,128,768円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	707,928,249円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	227,172,109円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	120,184,802円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	238,272,323円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	1,100,408,407円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	41,184,328円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	144,060,975円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	110,848,238円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	4,390,747円
日興F W S・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	3,538,994,064円
三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド	308,383,784円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	4,794,872円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	2,984,752円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	4,237,118円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	1,375,801円

三井住友D S ・ D C ターゲットイヤーファンド2065	798,513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)	679,469円
三井住友D S ・ F W 専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	8,896,240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)	37,964,348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)	21,297,579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)	7,206,277円
S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	5,112,653,950円
S M A M ・ バランスファンドV A 安定成長型<適格機関投資家限定>	21,269,064円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	4,037,458,005円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	3,597,206,169円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	8,585,342,356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>	28,565,773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>	68,538,172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>	647,667,067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>	97,653,517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>	843,878,697円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 5 0 <適格機関投資家専用>	1,219,045,963円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用>	1,182,676,466円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 <適格機関投資家専用>	3,570,435,999円
S M A M ・ 外国債券パッシブファンドV A <適格機関投資家限定>	6,168,455,377円
三井住友・外国債券インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	291,026,315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>	101,932,994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>	55,570,310円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A <適格機関投資家専用>	29,310,007円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A <適格機関投資家専用>	11,741,981円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L <適格機関投資家専用>	63,095,153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>	324,638,043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>	69,680,156円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 <適格機関投資家専用>	37,190,973円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 <適格機関投資家専用>	5,805,044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>	774,550,947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>	475,694,440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>	617,018,437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>	244,430,422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>	211,356,046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>	139,618,688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>	73,927,877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>	118,450,386円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド <適格機関投資家限定>	1,151,299,991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>	354,052,429円
合 計	81,276,928,619円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	T 0.25 05/31/25	4,400,000.00	4,158,132.00	
		T 0.25 06/30/25	2,900,000.00	2,731,887.00	
		T 0.25 07/31/25	300,000.00	281,553.00	
		T 0.25 09/30/25	2,000,000.00	1,864,200.00	
		T 0.25 10/31/25	1,000,000.00	929,120.00	
		T 0.375 01/31/26	2,500,000.00	2,305,075.00	
		T 0.375 04/30/25	3,000,000.00	2,850,450.00	
		T 0.375 07/31/27	2,500,000.00	2,183,050.00	
		T 0.375 09/30/27	4,800,000.00	4,165,872.00	
		T 0.375 11/30/25	2,000,000.00	1,855,820.00	
		T 0.375 12/31/25	3,000,000.00	2,775,390.00	
		T 0.5 03/31/25	1,600,000.00	1,527,312.00	
		T 0.5 04/30/27	1,200,000.00	1,061,568.00	
		T 0.5 05/31/27	2,500,000.00	2,204,325.00	
		T 0.5 06/30/27	4,000,000.00	3,518,560.00	
		T 0.5 10/31/27	1,000,000.00	869,080.00	
		T 0.625 03/31/27	2,400,000.00	2,139,000.00	
		T 0.625 05/15/30	5,000,000.00	4,005,350.00	
		T 0.625 07/31/26	800,000.00	728,936.00	
		T 0.625 08/15/30	4,800,000.00	3,812,208.00	
		T 0.625 11/30/27	3,400,000.00	2,961,162.00	
		T 0.625 12/31/27	7,200,000.00	6,252,696.00	
		T 0.75 01/31/28	5,900,000.00	5,136,068.00	
		T 0.75 04/30/26	1,500,000.00	1,382,100.00	
		T 0.75 05/31/26	2,000,000.00	1,837,560.00	
		T 0.75 08/31/26	1,500,000.00	1,367,130.00	
		T 0.875 06/30/26	2,000,000.00	1,838,980.00	
		T 0.875 09/30/26	2,500,000.00	2,281,050.00	
		T 0.875 11/15/30	4,900,000.00	3,934,602.00	
		T 1 07/31/28	2,900,000.00	2,512,676.00	
		T 1.125 02/15/31	5,700,000.00	4,635,012.00	
		T 1.125 02/28/25	1,500,000.00	1,445,385.00	
		T 1.125 02/28/27	2,000,000.00	1,814,100.00	
		T 1.125 05/15/40	3,800,000.00	2,330,388.00	
T 1.125 08/15/40	3,100,000.00	1,883,343.00			
T 1.125 08/31/28	3,500,000.00	3,042,655.00			
T 1.125 10/31/26	3,700,000.00	3,387,202.00			
T 1.25 05/15/50	5,100,000.00	2,557,854.00			

T 1.25 05/31/28	3,000,000.00	2,640,630.00	
T 1.25 06/30/28	3,000,000.00	2,634,840.00	
T 1.25 08/15/31	5,200,000.00	4,197,856.00	
T 1.25 09/30/28	3,000,000.00	2,616,900.00	
T 1.25 11/30/26	4,200,000.00	3,849,384.00	
T 1.25 12/31/26	2,600,000.00	2,379,182.00	
T 1.375 08/15/50	4,500,000.00	2,332,350.00	
T 1.375 08/31/26	600,000.00	555,594.00	
T 1.375 10/31/28	3,000,000.00	2,626,980.00	
T 1.375 11/15/31	4,900,000.00	3,967,138.00	
T 1.375 11/15/40	3,500,000.00	2,209,480.00	
T 1.375 12/31/28	1,000,000.00	872,080.00	
T 1.5 01/31/27	3,400,000.00	3,124,532.00	
T 1.5 02/15/30	2,100,000.00	1,791,762.00	
T 1.5 11/30/28	4,500,000.00	3,956,535.00	
T 1.625 02/15/26	2,900,000.00	2,736,353.00	
T 1.625 05/15/26	11,450,000.00	10,738,840.50	
T 1.625 05/15/31	5,500,000.00	4,596,240.00	
T 1.625 08/15/29	3,750,000.00	3,272,212.50	
T 1.625 09/30/26	900,000.00	837,396.00	
T 1.625 11/15/50	3,200,000.00	1,774,304.00	
T 1.625 11/30/26	200,000.00	185,238.00	
T 1.75 01/31/29	3,300,000.00	2,925,384.00	
T 1.75 03/15/25	1,500,000.00	1,452,165.00	
T 1.75 08/15/41	4,400,000.00	2,914,736.00	
T 1.75 11/15/29	1,300,000.00	1,137,032.00	
T 1.75 12/31/26	2,500,000.00	2,319,525.00	
T 1.875 02/15/32	5,300,000.00	4,437,478.00	
T 1.875 02/15/41	3,300,000.00	2,259,510.00	
T 1.875 02/15/51	5,800,000.00	3,429,308.00	
T 1.875 02/28/27	3,400,000.00	3,153,160.00	
T 1.875 02/28/29	2,800,000.00	2,493,400.00	
T 1.875 07/31/26	2,500,000.00	2,347,000.00	
T 1.875 11/15/51	3,300,000.00	1,941,192.00	
T 2 02/15/50	2,800,000.00	1,722,980.00	
T 2 08/15/25	3,300,000.00	3,170,574.00	
T 2 08/15/51	2,900,000.00	1,764,215.00	
T 2 11/15/26	1,000,000.00	936,030.00	
T 2 11/15/41	3,800,000.00	2,617,250.00	
T 2.125 05/15/25	600,000.00	580,752.00	
T 2.25 02/15/27	4,400,000.00	4,127,904.00	
T 2.25 02/15/52	1,700,000.00	1,098,047.00	
T 2.25 03/31/26	8,200,000.00	7,813,206.00	
T 2.25 05/15/41	5,000,000.00	3,629,950.00	

T 2.25 08/15/27	4,200,000.00	3,907,554.00	
T 2.25 08/15/46	1,950,000.00	1,312,896.00	
T 2.25 08/15/49	3,500,000.00	2,293,795.00	
T 2.25 11/15/25	4,000,000.00	3,836,240.00	
T 2.25 11/15/27	4,400,000.00	4,077,216.00	
T 2.375 02/15/42	2,800,000.00	2,046,184.00	
T 2.375 03/31/29	5,000,000.00	4,555,450.00	
T 2.375 05/15/27	3,000,000.00	2,813,190.00	
T 2.375 05/15/29	2,400,000.00	2,182,584.00	
T 2.375 05/15/51	3,900,000.00	2,600,169.00	
T 2.375 11/15/49	1,900,000.00	1,278,814.00	
T 2.5 02/15/45	1,400,000.00	1,007,412.00	
T 2.5 02/15/46	1,000,000.00	711,500.00	
T 2.5 02/28/26	2,100,000.00	2,013,564.00	
T 2.5 03/31/27	3,000,000.00	2,831,280.00	
T 2.5 05/15/46	1,000,000.00	709,960.00	
T 2.625 01/31/26	2,200,000.00	2,116,884.00	
T 2.625 02/15/29	1,800,000.00	1,662,912.00	
T 2.625 03/31/25	1,000,000.00	975,710.00	
T 2.625 04/15/25	4,500,000.00	4,387,500.00	
T 2.625 05/31/27	4,800,000.00	4,533,936.00	
T 2.625 07/31/29	1,100,000.00	1,010,163.00	
T 2.625 12/31/25	1,400,000.00	1,348,690.00	
T 2.75 02/15/28	5,300,000.00	4,983,749.00	
T 2.75 02/28/25	2,000,000.00	1,957,140.00	
T 2.75 04/30/27	1,600,000.00	1,519,120.00	
T 2.75 05/15/25	3,000,000.00	2,924,100.00	
T 2.75 05/31/29	1,400,000.00	1,296,498.00	
T 2.75 06/30/25	900,000.00	875,529.00	
T 2.75 08/15/32	4,200,000.00	3,735,606.00	
T 2.75 08/15/42	2,000,000.00	1,546,520.00	
T 2.75 08/15/47	1,800,000.00	1,326,078.00	
T 2.75 08/31/25	3,400,000.00	3,298,000.00	
T 2.75 11/15/42	300,000.00	231,168.00	
T 2.75 11/15/47	1,500,000.00	1,103,340.00	
T 2.875 04/30/25	400,000.00	390,780.00	
T 2.875 04/30/29	3,500,000.00	3,264,415.00	
T 2.875 05/15/28	3,500,000.00	3,298,260.00	
T 2.875 05/15/32	5,700,000.00	5,133,306.00	
T 2.875 05/15/43	1,200,000.00	938,364.00	
T 2.875 05/15/49	1,400,000.00	1,048,292.00	
T 2.875 05/15/52	3,200,000.00	2,380,352.00	
T 2.875 05/31/25	3,100,000.00	3,023,709.00	
T 2.875 06/15/25	2,000,000.00	1,949,640.00	

T 2.875 08/15/28	4,500,000.00	4,228,830.00	
T 2.875 08/15/45	800,000.00	613,008.00	
T 2.875 11/15/46	3,000,000.00	2,276,250.00	
T 2.875 11/30/25	2,500,000.00	2,421,125.00	
T 3 02/15/47	2,500,000.00	1,936,800.00	
T 3 02/15/48	2,400,000.00	1,847,808.00	
T 3 02/15/49	3,300,000.00	2,532,486.00	
T 3 05/15/42	800,000.00	644,728.00	
T 3 05/15/45	900,000.00	706,410.00	
T 3 05/15/47	2,700,000.00	2,089,017.00	
T 3 07/15/25	2,000,000.00	1,950,140.00	
T 3 08/15/48	2,000,000.00	1,536,980.00	
T 3 08/15/52	3,000,000.00	2,290,830.00	
T 3 09/30/25	1,000,000.00	972,460.00	
T 3 10/31/25	2,600,000.00	2,525,250.00	
T 3 11/15/44	1,000,000.00	787,920.00	
T 3 11/15/45	800,000.00	625,400.00	
T 3.125 02/15/42	1,000,000.00	824,800.00	
T 3.125 02/15/43	2,300,000.00	1,875,443.00	
T 3.125 05/15/48	2,400,000.00	1,889,520.00	
T 3.125 08/15/25	3,000,000.00	2,927,160.00	
T 3.125 08/15/44	700,000.00	564,207.00	
T 3.125 08/31/29	2,700,000.00	2,540,565.00	
T 3.125 11/15/28	2,900,000.00	2,748,243.00	
T 3.125 11/15/41	1,000,000.00	828,200.00	
T 3.25 05/15/42	2,200,000.00	1,839,442.00	
T 3.25 06/30/29	3,000,000.00	2,844,900.00	
T 3.375 05/15/33	5,500,000.00	5,107,135.00	
T 3.375 05/15/44	500,000.00	420,035.00	
T 3.375 08/15/42	3,000,000.00	2,548,590.00	
T 3.375 11/15/48	3,100,000.00	2,551,021.00	
T 3.5 01/31/28	1,000,000.00	967,050.00	
T 3.5 01/31/30	2,500,000.00	2,390,475.00	
T 3.5 02/15/33	6,100,000.00	5,728,388.00	
T 3.5 02/15/39	200,000.00	181,082.00	
T 3.5 04/30/30	2,500,000.00	2,386,600.00	
T 3.625 02/15/44	300,000.00	262,134.00	
T 3.625 02/15/53	1,700,000.00	1,468,970.00	
T 3.625 03/31/28	3,000,000.00	2,912,670.00	
T 3.625 03/31/30	1,200,000.00	1,154,052.00	
T 3.625 05/15/26	2,500,000.00	2,446,525.00	
T 3.625 05/15/53	2,100,000.00	1,815,954.00	
T 3.625 05/31/28	2,000,000.00	1,940,740.00	
T 3.625 08/15/43	500,000.00	437,840.00	

T 3.75 04/15/26	3,300,000.00	3,238,422.00	
T 3.75 05/31/30	3,000,000.00	2,902,770.00	
T 3.75 06/30/30	4,400,000.00	4,255,680.00	
T 3.75 08/15/41	1,100,000.00	998,393.00	
T 3.75 11/15/43	700,000.00	623,581.00	
T 3.75 12/31/28	1,000,000.00	973,900.00	
T 3.75 12/31/30	2,400,000.00	2,317,488.00	
T 3.875 01/15/26	5,300,000.00	5,216,631.00	
T 3.875 02/15/43	2,600,000.00	2,365,948.00	
T 3.875 04/30/25	1,000,000.00	987,710.00	
T 3.875 05/15/43	1,500,000.00	1,362,675.00	
T 3.875 08/15/33	6,000,000.00	5,791,380.00	
T 3.875 08/15/40	500,000.00	465,145.00	
T 3.875 09/30/29	2,300,000.00	2,246,387.00	
T 3.875 12/31/27	4,400,000.00	4,312,924.00	
T 3.875 12/31/29	1,500,000.00	1,463,580.00	
T 4 01/15/27	4,900,000.00	4,829,342.00	
T 4 01/31/29	4,100,000.00	4,037,844.00	
T 4 02/15/26	2,000,000.00	1,973,040.00	
T 4 02/15/34	2,200,000.00	2,144,824.00	
T 4 02/28/30	1,500,000.00	1,472,280.00	
T 4 02/29/28	5,000,000.00	4,923,000.00	
T 4 06/30/28	3,000,000.00	2,953,530.00	
T 4 07/31/30	2,200,000.00	2,157,364.00	
T 4 10/31/29	1,600,000.00	1,572,080.00	
T 4 11/15/42	2,000,000.00	1,855,700.00	
T 4 11/15/52	2,600,000.00	2,406,196.00	
T 4.125 02/15/27	2,000,000.00	1,978,040.00	
T 4.125 06/15/26	2,000,000.00	1,977,260.00	
T 4.125 07/31/28	1,000,000.00	989,430.00	
T 4.125 08/15/53	1,000,000.00	946,480.00	
T 4.125 08/31/30	500,000.00	493,680.00	
T 4.125 10/31/27	3,500,000.00	3,460,345.00	
T 4.125 11/15/32	5,600,000.00	5,517,064.00	
T 4.25 01/31/26	3,300,000.00	3,269,178.00	
T 4.25 02/15/54	1,000,000.00	969,140.00	
T 4.25 05/15/39	100,000.00	98,398.00	
T 4.25 10/15/25	2,000,000.00	1,981,160.00	
T 4.25 11/15/40	600,000.00	583,206.00	
T 4.25 12/31/25	3,500,000.00	3,467,030.00	
T 4.375 05/15/40	900,000.00	892,134.00	
T 4.375 05/15/41	300,000.00	295,146.00	
T 4.375 08/15/26	4,000,000.00	3,977,320.00	
T 4.375 08/15/43	500,000.00	486,480.00	

T 4.375 08/31/28	1,000,000.00	999,600.00	
T 4.375 11/15/39	300,000.00	298,347.00	
T 4.375 11/30/28	1,900,000.00	1,901,102.00	
T 4.375 11/30/30	1,900,000.00	1,902,888.00	
T 4.375 12/15/26	4,000,000.00	3,981,640.00	
T 4.5 02/15/44	1,600,000.00	1,588,112.00	
T 4.5 05/15/38	2,000,000.00	2,035,460.00	
T 4.5 07/15/26	3,900,000.00	3,887,637.00	
T 4.5 08/15/39	300,000.00	303,057.00	
T 4.5 11/15/25	3,800,000.00	3,779,366.00	
T 4.5 11/15/33	4,500,000.00	4,561,155.00	
T 4.625 02/15/40	1,000,000.00	1,021,500.00	
T 4.625 02/28/25	3,800,000.00	3,783,242.00	
T 4.625 03/15/26	2,500,000.00	2,495,500.00	
T 4.625 09/15/26	4,000,000.00	4,001,840.00	
T 4.625 09/30/28	2,500,000.00	2,524,400.00	
T 4.625 09/30/30	1,500,000.00	1,523,280.00	
T 4.625 10/15/26	1,000,000.00	1,000,830.00	
T 4.625 11/15/26	4,800,000.00	4,805,904.00	
T 4.75 02/15/41	900,000.00	928,521.00	
T 4.75 11/15/43	700,000.00	715,470.00	
T 4.75 11/15/53	300,000.00	315,513.00	
T 4.875 10/31/28	1,400,000.00	1,428,756.00	
T 5.25 11/15/28	500,000.00	518,330.00	
T 5.375 02/15/31	320,000.00	341,350.40	
T 6 02/15/26	1,000,000.00	1,024,060.00	
T 6.125 11/15/27	1,000,000.00	1,055,810.00	
アメリカ・ドル小計	628,170,000.00	556,710,203.40 (83,127,967,572)	
カナダ・ドル	CAN 0.5 09/01/25	2,700,000.00	2,554,038.00
	CAN 1 06/01/27	800,000.00	734,776.00
	CAN 1.25 03/01/27	400,000.00	371,180.00
	CAN 1.25 06/01/30	800,000.00	698,856.00
	CAN 1.5 04/01/25	300,000.00	290,577.00
	CAN 1.5 06/01/26	2,600,000.00	2,460,094.00
	CAN 1.5 12/01/31	2,100,000.00	1,810,263.00
	CAN 1.75 12/01/53	1,100,000.00	761,750.00
	CAN 2 06/01/28	700,000.00	656,229.00
	CAN 2 06/01/32	2,000,000.00	1,779,560.00
	CAN 2.25 06/01/25	500,000.00	486,840.00
	CAN 2.25 06/01/29	1,100,000.00	1,034,407.00
	CAN 2.25 12/01/29	1,600,000.00	1,498,128.00
	CAN 2.5 12/01/32	2,930,000.00	2,699,555.50
	CAN 2.75 06/01/33	1,800,000.00	1,687,662.00

	CAN 2.75 09/01/27	2,300,000.00	2,226,032.00	
	CAN 2.75 12/01/48	1,300,000.00	1,151,046.00	
	CAN 2.75 12/01/55	800,000.00	700,216.00	
	CAN 3 04/01/26	400,000.00	391,104.00	
	CAN 3 10/01/25	900,000.00	881,316.00	
	CAN 3.25 12/01/33	300,000.00	292,800.00	
	CAN 3.5 08/01/25	1,300,000.00	1,282,931.00	
	CAN 3.5 12/01/45	1,200,000.00	1,204,800.00	
	CAN 4 06/01/41	1,300,000.00	1,382,225.00	
	CAN 4.5 11/01/25	1,800,000.00	1,803,276.00	
	CAN 5 06/01/37	400,000.00	460,908.00	
	CAN 5.75 06/01/29	250,000.00	276,057.50	
	CAN 5.75 06/01/33	300,000.00	351,147.00	
	CANADA 2.75 12/01/64	700,000.00	608,230.00	
	カナダ・ドル小計	34,680,000.00	32,536,004.00 (3,587,094,441)	
オーストラ リア・ドル	ACGB 0.25 11/21/25	1,300,000.00	1,224,392.00	
	ACGB 0.5 09/21/26	200,000.00	184,628.00	
	ACGB 1.25 05/21/32	800,000.00	644,328.00	
	ACGB 1.5 06/21/31	4,100,000.00	3,460,359.00	
	ACGB 1.75 06/21/51	500,000.00	283,855.00	
	ACGB 1.75 11/21/32	1,400,000.00	1,161,440.00	
	ACGB 2.25 05/21/28	1,300,000.00	1,224,275.00	
	ACGB 2.5 05/21/30	2,400,000.00	2,216,760.00	
	ACGB 2.75 05/21/41	600,000.00	479,760.00	
	ACGB 2.75 06/21/35	800,000.00	697,584.00	
	ACGB 2.75 11/21/27	2,400,000.00	2,318,064.00	
	ACGB 2.75 11/21/28	200,000.00	191,158.00	
	ACGB 2.75 11/21/29	1,800,000.00	1,699,056.00	
	ACGB 3 03/21/47	1,200,000.00	941,352.00	
	ACGB 3 11/21/33	900,000.00	819,342.00	
	ACGB 3.25 04/21/29	800,000.00	779,024.00	
	ACGB 3.25 06/21/39	2,000,000.00	1,755,740.00	
	ACGB 3.75 04/21/37	1,100,000.00	1,044,362.00	
ACGB 4.25 04/21/26	2,150,000.00	2,169,887.50		
ACGB 4.5 04/21/33	1,500,000.00	1,543,830.00		
	オーストラリア・ドル小計	27,450,000.00	24,839,196.50 (2,432,999,297)	
シンガポ ール・ドル	SIGB 0.5 11/01/25	200,000.00	190,776.00	
	SIGB 1.25 11/01/26	800,000.00	760,640.00	
	SIGB 1.625 07/01/31	1,000,000.00	904,500.00	
	SIGB 2.25 08/01/36	1,000,000.00	915,500.00	
	SIGB 2.625 05/01/28	800,000.00	785,920.00	
	SIGB 2.75 03/01/46	1,000,000.00	956,000.00	

	SIGB 2.75 04/01/42	700,000.00	670,082.00	
	SIGB 2.875 09/01/30	200,000.00	197,440.00	
	SIGB 3.375 09/01/33	400,000.00	409,444.00	
	SIGB 3.5 03/01/27	880,000.00	888,624.00	
	シンガポール・ドル小計	6,980,000.00	6,678,926.00 (745,034,195)	
ニュージー ランド・ド ル	NZGB 0.5 05/15/26	200,000.00	182,826.00	
	NZGB 1.75 05/15/41	1,200,000.00	759,348.00	
	NZGB 2 05/15/32	1,120,000.00	923,753.60	
	NZGB 2.75 04/15/25	550,000.00	535,546.00	
	NZGB 2.75 05/15/51	500,000.00	337,490.00	
	NZGB 3 04/20/29	1,000,000.00	933,600.00	
	NZGB 4.5 04/15/27	1,100,000.00	1,098,229.00	
	NZGB 4.5 05/15/30	170,000.00	169,988.10	
	ニュージーランド・ドル小計	5,840,000.00	4,940,780.70 (449,067,558)	
イギリス・ ボンド	UK TSY GILT 1.125 01/31/39	600,000.00	388,860.00	
	UKT 0.125 01/30/26	1,500,000.00	1,388,400.00	
	UKT 0.125 01/31/28	1,700,000.00	1,462,765.00	
	UKT 0.25 07/31/31	1,300,000.00	994,435.00	
	UKT 0.375 10/22/26	2,000,000.00	1,812,020.00	
	UKT 0.375 10/22/30	600,000.00	476,892.00	
	UKT 0.5 01/31/29	2,050,000.00	1,735,099.50	
	UKT 0.5 10/22/61	1,200,000.00	363,228.00	
	UKT 0.625 06/07/25	900,000.00	858,267.00	
	UKT 0.625 07/31/35	1,700,000.00	1,160,250.00	
	UKT 0.875 01/31/46	400,000.00	200,120.00	
	UKT 0.875 07/31/33	1,300,000.00	980,304.00	
	UKT 0.875 10/22/29	500,000.00	423,505.00	
	UKT 1 01/31/32	2,100,000.00	1,679,202.00	
	UKT 1.125 10/22/73	300,000.00	111,330.00	
	UKT 1.25 07/22/27	900,000.00	820,593.00	
	UKT 1.25 07/31/51	1,200,000.00	592,080.00	
	UKT 1.25 10/22/41	2,700,000.00	1,660,230.00	
	UKT 1.5 07/22/26	1,100,000.00	1,034,000.00	
	UKT 1.5 07/22/47	2,000,000.00	1,137,400.00	
	UKT 1.625 10/22/28	900,000.00	812,232.00	
	UKT 1.625 10/22/54	500,000.00	264,620.00	
	UKT 1.75 01/22/49	1,950,000.00	1,153,893.00	
	UKT 1.75 09/07/37	100,000.00	74,244.00	
	UKT 2 09/07/25	1,100,000.00	1,060,411.00	
	UKT 2.5 07/22/65	1,600,000.00	1,028,672.00	
UKT 3.25 01/22/44	1,600,000.00	1,337,984.00		
UKT 3.25 01/31/33	2,400,000.00	2,261,232.00		

	UKT 3.5 01/22/45	1,250,000.00	1,080,187.50	
	UKT 3.5 07/22/68	1,300,000.00	1,078,870.00	
	UKT 3.5 10/22/25	700,000.00	688,387.00	
	UKT 3.75 01/29/38	1,100,000.00	1,033,714.00	
	UKT 3.75 07/22/52	1,200,000.00	1,056,840.00	
	UKT 4 01/22/60	1,300,000.00	1,196,650.00	
	UKT 4.125 01/29/27	1,700,000.00	1,692,860.00	
	UKT 4.25 03/07/36	700,000.00	703,577.00	
	UKT 4.25 06/07/32	500,000.00	510,125.00	
	UKT 4.25 09/07/39	600,000.00	591,528.00	
	UKT 4.25 12/07/27	900,000.00	904,617.00	
	UKT 4.25 12/07/40	600,000.00	588,240.00	
	UKT 4.25 12/07/46	1,500,000.00	1,443,375.00	
	UKT 4.25 12/07/49	900,000.00	863,307.00	
	UKT 4.25 12/07/55	1,700,000.00	1,630,300.00	
	UKT 4.5 09/07/34	400,000.00	412,612.00	
	UKT 4.5 12/07/42	1,050,000.00	1,055,145.00	
	UKT 4.625 01/31/34	1,400,000.00	1,459,682.00	
	UKT 4.75 12/07/30	1,150,000.00	1,203,877.50	
	UKT 4.75 12/07/38	1,000,000.00	1,043,690.00	
	UKT 5 03/07/25	800,000.00	801,856.00	
	UKT 6 12/07/28	650,000.00	705,841.50	
	イギリス・ポンド小計	58,600,000.00	49,017,550.00 (9,319,706,783)	
イスラエル・シュケル	ILGOV 0.5 04/30/25	3,100,000.00	2,987,315.00	
	ILGOV 1 03/31/30	1,400,000.00	1,171,478.00	
	ILGOV 1.5 05/31/37	1,200,000.00	838,404.00	
	ILGOV 2.25 09/28/28	1,900,000.00	1,762,668.00	
	ILGOV 3.75 02/28/29	500,000.00	493,870.00	
	ILGOV 3.75 03/31/47	3,600,000.00	3,084,804.00	
	ILGOV 6.25 10/30/26	3,300,000.00	3,488,661.00	
	イスラエル・シュケル小計	15,000,000.00	13,827,200.00 (562,183,532)	
デンマーク・クローネ	DGB 0 11/15/31	500,000.00	418,355.00	
	DGB 0.25 11/15/52	1,800,000.00	974,844.00	
	DGB 0.5 11/15/27	6,100,000.00	5,682,577.00	
	DGB 0.5 11/15/29	5,400,000.00	4,866,696.00	
	DGB 1.75 11/15/25	100,000.00	98,182.00	
	DGB 2.25 11/15/33	1,200,000.00	1,179,216.00	
	DGB 4.5 11/15/39	7,000,000.00	8,710,380.00	
	デンマーク・クローネ小計	22,100,000.00	21,930,250.00 (478,079,450)	
	NGB 1.375 08/19/30	6,800,000.00	5,954,556.00	
	NGB 1.5 02/19/26	2,300,000.00	2,201,054.00	

ノル ウェー・ク ローネ	NGB 1.75 02/17/27	700,000.00	663,047.00	
	NGB 1.75 03/13/25	1,200,000.00	1,171,344.00	
	NGB 1.75 09/06/29	5,000,000.00	4,551,400.00	
	NGB 2 04/26/28	5,900,000.00	5,537,445.00	
	NGB 3 08/15/33	1,100,000.00	1,044,692.00	
	NGB 3.5 10/06/42	1,300,000.00	1,328,340.00	
ノルウェー・クローネ小計		24,300,000.00	22,451,878.00 (316,122,442)	
スウェーデ ン・クロー ナ	SGB 0.125 05/12/31	500,000.00	426,825.00	
	SGB 0.75 05/12/28	3,700,000.00	3,453,469.00	
	SGB 0.75 11/12/29	4,200,000.00	3,849,552.00	
	SGB 1 11/12/26	6,200,000.00	5,935,198.00	
	SGB 2.5 05/12/25	5,000,000.00	4,958,450.00	
	SGB 3.5 03/30/39	5,300,000.00	5,910,295.00	
スウェーデン・クローナ小計		24,900,000.00	24,533,789.00 (353,286,562)	
メキシコ・ ペソ	MBONO 5 03/06/25	16,000,000.00	15,228,800.00	
	MBONO 5.5 03/04/27	5,000,000.00	4,482,250.00	
	MBONO 5.75 03/05/26	19,000,000.00	17,571,770.00	
	MBONO 7.5 05/26/33	6,000,000.00	5,366,640.00	
	MBONO 7.5 06/03/27	22,000,000.00	20,785,160.00	
	MBONO 7.75 05/29/31	29,000,000.00	26,786,140.00	
	MBONO 7.75 11/23/34	18,000,000.00	16,165,980.00	
	MBONO 8 11/07/47	13,000,000.00	11,287,640.00	
	MBONO 8.5 05/31/29	25,000,000.00	24,269,500.00	
	MBONO 8.5 11/18/38	40,000,000.00	37,419,200.00	
メキシコ・ペソ小計		193,000,000.00	179,363,080.00 (1,603,201,018)	
オフショ ア・人民元	CGB 2.18 08/15/26	22,800,000.00	22,807,524.00	
	CGB 2.18 08/25/25	39,000,000.00	39,069,420.00	
	CGB 2.24 05/25/25	31,000,000.00	31,082,150.00	
	CGB 2.3 05/15/26	17,000,000.00	17,057,120.00	
	CGB 2.37 01/15/29	17,000,000.00	17,091,800.00	
	CGB 2.39 11/15/26	55,000,000.00	55,336,050.00	
	CGB 2.4 07/15/28	41,000,000.00	41,195,570.00	
	CGB 2.46 02/15/26	29,000,000.00	29,185,890.00	
	CGB 2.48 04/15/27	9,000,000.00	9,074,160.00	
	CGB 2.5 07/25/27	13,000,000.00	13,105,430.00	
	CGB 2.52 08/25/33	11,000,000.00	11,095,040.00	
	CGB 2.54 12/25/30	27,000,000.00	27,287,010.00	
	CGB 2.55 10/15/28	11,000,000.00	11,136,400.00	
	CGB 2.6 09/15/30	32,000,000.00	32,437,120.00	
	CGB 2.62 04/15/28	27,000,000.00	27,367,470.00	
CGB 2.62 06/25/30	22,000,000.00	22,308,660.00		

	CGB 2.62 09/25/29	19,000,000.00	19,261,820.00	
	CGB 2.64 01/15/28	31,500,000.00	31,933,125.00	
	CGB 2.67 05/25/33	5,000,000.00	5,102,550.00	
	CGB 2.67 11/25/33	15,000,000.00	15,414,900.00	
	CGB 2.69 08/12/26	50,000,000.00	50,613,000.00	
	CGB 2.8 03/24/29	26,000,000.00	26,610,220.00	
	CGB 2.8 03/25/30	15,000,000.00	15,362,550.00	
	CGB 2.8 11/15/32	21,000,000.00	21,611,520.00	
	CGB 2.88 02/25/33	10,900,000.00	11,294,144.00	
	CGB 2.91 10/14/28	21,000,000.00	21,595,770.00	
	CGB 3 10/15/53	6,000,000.00	6,581,340.00	
	CGB 3.02 05/27/31	43,000,000.00	44,810,730.00	
	CGB 3.12 10/25/52	16,000,000.00	17,513,120.00	
	CGB 3.19 04/15/53	8,000,000.00	9,042,160.00	
	CGB 3.72 04/12/51	38,700,000.00	46,641,240.00	
	オフショア・人民元小計	729,900,000.00	750,025,003.00 (15,537,592,965)	
マレーシア・リンギット	MGS 3.502 05/31/27	5,100,000.00	5,103,927.00	
	MGS 3.582 07/15/32	2,500,000.00	2,448,950.00	
	MGS 3.757 05/22/40	1,400,000.00	1,355,256.00	
	MGS 3.882 03/14/25	500,000.00	502,840.00	
	MGS 3.9 11/30/26	1,300,000.00	1,314,365.00	
	MGS 3.955 09/15/25	3,200,000.00	3,224,800.00	
	MGS 4.498 04/15/30	4,000,000.00	4,159,440.00	
	MGS 4.504 04/30/29	700,000.00	727,741.00	
	MGS 4.696 10/15/42	1,700,000.00	1,836,544.00	
MGS 4.736 03/15/46	6,700,000.00	7,265,882.00		
	マレーシア・リンギット小計	27,100,000.00	27,939,745.00 (884,689,674)	
ポーランド・ズロチ	POLGB 0 10/25/25	5,000,000.00	4,614,400.00	
	POLGB 0.25 10/25/26	7,900,000.00	6,990,315.00	
	POLGB 0.75 04/25/25	1,800,000.00	1,719,936.00	
	POLGB 1.25 10/25/30	9,500,000.00	7,417,505.00	
	POLGB 2.75 04/25/28	3,000,000.00	2,736,090.00	
	POLGB 2.75 10/25/29	700,000.00	617,351.00	
	POLGB 6 10/25/33	2,000,000.00	2,082,480.00	
	ポーランド・ズロチ小計	29,900,000.00	26,178,077.00 (988,769,529)	
ユーロ	BGB 0 10/22/27	800,000.00	725,768.00	
	BGB 0 10/22/31	1,500,000.00	1,217,025.00	
	BGB 0.1 06/22/30	700,000.00	595,672.00	
	BGB 0.35 06/22/32	700,000.00	573,615.00	
	BGB 0.4 06/22/40	800,000.00	517,440.00	
	BGB 0.65 06/22/71	400,000.00	171,124.00	

BGB 0.8 06/22/25	700,000.00	678,349.00	
BGB 0.8 06/22/27	800,000.00	751,128.00	
BGB 0.8 06/22/28	1,000,000.00	924,430.00	
BGB 0.9 06/22/29	900,000.00	821,799.00	
BGB 1 06/22/26	700,000.00	670,943.00	
BGB 1 06/22/31	1,300,000.00	1,149,148.00	
BGB 1.25 04/22/33	900,000.00	787,509.00	
BGB 1.45 06/22/37	1,200,000.00	987,060.00	
BGB 1.6 06/22/47	650,000.00	470,281.50	
BGB 1.7 06/22/50	1,100,000.00	787,182.00	
BGB 1.9 06/22/38	1,000,000.00	858,170.00	
BGB 2.15 06/22/66	500,000.00	379,655.00	
BGB 2.25 06/22/57	500,000.00	391,305.00	
BGB 3 06/22/34	200,000.00	201,128.00	
BGB 3.45 06/22/43	500,000.00	511,285.00	
BGB 3.75 06/22/45	600,000.00	641,076.00	
BGB 4 03/28/32	300,000.00	325,536.00	
BGB 4.25 03/28/41	680,000.00	770,800.40	
BGB 4.5 03/28/26	1,100,000.00	1,132,736.00	
BGB 5 03/28/35	1,000,000.00	1,187,960.00	
BGB 5.5 03/28/28	1,000,000.00	1,104,830.00	
BK0 3.1 09/18/25	300,000.00	299,781.00	
BTPS 0 08/01/26	1,300,000.00	1,205,087.00	
BTPS 0.45 02/15/29	2,400,000.00	2,100,408.00	
BTPS 0.5 02/01/26	1,500,000.00	1,424,340.00	
BTPS 0.85 01/15/27	900,000.00	843,705.00	
BTPS 0.9 04/01/31	2,000,000.00	1,689,980.00	
BTPS 0.95 03/01/37	1,000,000.00	707,150.00	
BTPS 0.95 06/01/32	3,300,000.00	2,709,102.00	
BTPS 0.95 08/01/30	1,200,000.00	1,035,564.00	
BTPS 0.95 09/15/27	800,000.00	742,248.00	
BTPS 0.95 12/01/31	2,600,000.00	2,164,916.00	
BTPS 1.1 04/01/27	1,500,000.00	1,410,300.00	
BTPS 1.25 12/01/26	800,000.00	760,584.00	
BTPS 1.45 03/01/36	400,000.00	310,236.00	
BTPS 1.45 05/15/25	700,000.00	684,117.00	
BTPS 1.5 06/01/25	1,900,000.00	1,856,205.00	
BTPS 1.6 06/01/26	1,200,000.00	1,158,576.00	
BTPS 1.65 12/01/30	1,100,000.00	985,853.00	
BTPS 1.7 09/01/51	1,500,000.00	929,205.00	
BTPS 1.85 07/01/25	1,000,000.00	980,180.00	
BTPS 2 02/01/28	2,500,000.00	2,395,750.00	
BTPS 2 12/01/25	1,300,000.00	1,271,998.00	
BTPS 2.05 08/01/27	1,500,000.00	1,447,260.00	

BTPS 2.1 07/15/26	1,000,000.00	974,840.00	
BTPS 2.2 06/01/27	900,000.00	873,801.00	
BTPS 2.25 09/01/36	500,000.00	422,330.00	
BTPS 2.45 09/01/33	600,000.00	545,580.00	
BTPS 2.45 09/01/50	1,700,000.00	1,254,396.00	
BTPS 2.5 11/15/25	1,200,000.00	1,184,436.00	
BTPS 2.65 12/01/27	400,000.00	392,976.00	
BTPS 2.7 03/01/47	1,250,000.00	997,862.50	
BTPS 2.8 03/01/67	700,000.00	524,601.00	
BTPS 2.8 06/15/29	1,000,000.00	978,110.00	
BTPS 2.8 12/01/28	1,300,000.00	1,278,290.00	
BTPS 2.95 02/15/27	2,500,000.00	2,482,050.00	
BTPS 2.95 09/01/38	1,000,000.00	891,510.00	
BTPS 3 08/01/29	2,600,000.00	2,567,370.00	
BTPS 3.1 03/01/40	700,000.00	625,093.00	
BTPS 3.25 03/01/38	800,000.00	740,904.00	
BTPS 3.25 09/01/46	1,600,000.00	1,405,904.00	
BTPS 3.35 03/01/35	700,000.00	675,276.00	
BTPS 3.45 03/01/48	1,000,000.00	902,880.00	
BTPS 3.5 02/15/31	1,000,000.00	1,004,570.00	
BTPS 3.5 03/01/30	1,000,000.00	1,010,980.00	
BTPS 3.7 06/15/30	1,900,000.00	1,934,998.00	
BTPS 3.85 09/01/49	1,100,000.00	1,053,239.00	
BTPS 3.85 09/15/26	2,900,000.00	2,942,572.00	
BTPS 3.85 12/15/29	1,300,000.00	1,336,166.00	
BTPS 4 02/01/37	2,000,000.00	2,034,360.00	
BTPS 4 04/30/35	1,100,000.00	1,126,301.00	
BTPS 4.1 02/01/29	700,000.00	727,153.00	
BTPS 4.4 05/01/33	1,700,000.00	1,806,624.00	
BTPS 4.5 03/01/26	1,300,000.00	1,329,146.00	
BTPS 4.75 09/01/28	1,800,000.00	1,914,390.00	
BTPS 4.75 09/01/44	1,200,000.00	1,304,448.00	
BTPS 5 03/01/25	1,000,000.00	1,012,860.00	
BTPS 5 08/01/34	1,570,000.00	1,743,422.20	
BTPS 5 08/01/39	1,800,000.00	1,999,404.00	
BTPS 5 09/01/40	1,700,000.00	1,890,621.00	
BTPS 5.75 02/01/33	1,700,000.00	1,977,355.00	
BTPS 6 05/01/31	2,200,000.00	2,565,178.00	
BTPS 6.5 11/01/27	1,700,000.00	1,893,681.00	
BTPS 7.25 11/01/26	400,000.00	440,260.00	
DBR 0 02/15/30	1,500,000.00	1,305,060.00	
DBR 0 02/15/32	3,200,000.00	2,658,176.00	
DBR 0 05/15/35	2,000,000.00	1,520,840.00	
DBR 0 05/15/36	800,000.00	591,000.00	

DBR 0 08/15/29	2,500,000.00	2,198,750.00	
DBR 0 08/15/30	2,500,000.00	2,151,000.00	
DBR 0 08/15/31	200,000.00	168,224.00	
DBR 0 08/15/31	2,300,000.00	1,935,496.00	
DBR 0 08/15/50	3,000,000.00	1,546,800.00	
DBR 0 08/15/50	900,000.00	465,597.00	
DBR 0 11/15/27	1,300,000.00	1,185,938.00	
DBR 0 11/15/28	400,000.00	357,540.00	
DBR 0.25 02/15/27	300,000.00	280,146.00	
DBR 0.25 02/15/29	1,200,000.00	1,080,468.00	
DBR 0.25 08/15/28	1,500,000.00	1,363,560.00	
DBR 0.5 02/15/26	3,200,000.00	3,058,944.00	
DBR 0.5 02/15/28	1,600,000.00	1,482,320.00	
DBR 0.5 08/15/27	2,100,000.00	1,960,350.00	
DBR 1 05/15/38	1,600,000.00	1,302,416.00	
DBR 1 08/15/25	1,900,000.00	1,844,102.00	
DBR 1.25 08/15/48	1,650,000.00	1,257,267.00	
DBR 1.7 08/15/32	2,400,000.00	2,275,656.00	
DBR 1.8 08/15/53	200,000.00	168,398.00	
DBR 1.8 08/15/53	1,500,000.00	1,264,890.00	
DBR 2.1 11/15/29	1,400,000.00	1,375,388.00	
DBR 2.3 02/15/33	1,600,000.00	1,586,576.00	
DBR 2.3 02/15/33	800,000.00	793,688.00	
DBR 2.4 11/15/30	1,100,000.00	1,098,845.00	
DBR 2.5 07/04/44	1,600,000.00	1,570,144.00	
DBR 2.5 08/15/46	2,700,000.00	2,654,667.00	
DBR 3.25 07/04/42	1,000,000.00	1,091,000.00	
DBR 4 01/04/37	1,300,000.00	1,504,425.00	
DBR 4.25 07/04/39	700,000.00	844,543.00	
DBR 4.75 07/04/28	1,600,000.00	1,744,464.00	
DBR 4.75 07/04/34	600,000.00	723,594.00	
DBR 4.75 07/04/40	1,450,000.00	1,859,509.00	
DBR 5.5 01/04/31	900,000.00	1,071,837.00	
DBR 5.625 01/04/28	1,000,000.00	1,109,600.00	
DBR 6.25 01/04/30	800,000.00	962,448.00	
DBR 6.5 07/04/27	1,000,000.00	1,119,840.00	
FRTR 0 02/25/26	2,000,000.00	1,888,600.00	
FRTR 0 02/25/27	1,100,000.00	1,013,782.00	
FRTR 0 03/25/25	1,900,000.00	1,835,267.00	
FRTR 0 05/25/32	2,900,000.00	2,317,970.00	
FRTR 0 11/25/29	3,500,000.00	3,007,865.00	
FRTR 0 11/25/30	3,600,000.00	3,009,780.00	
FRTR 0 11/25/31	3,000,000.00	2,435,640.00	
FRTR 0.25 11/25/26	2,900,000.00	2,707,730.00	

FRTR 0.5 05/25/25	1,300,000.00	1,257,438.00	
FRTR 0.5 05/25/26	3,100,000.00	2,942,768.00	
FRTR 0.5 05/25/29	3,000,000.00	2,683,050.00	
FRTR 0.5 05/25/40	1,300,000.00	867,373.00	
FRTR 0.5 05/25/72	100,000.00	39,317.00	
FRTR 0.5 06/25/44	1,200,000.00	721,524.00	
FRTR 0.75 02/25/28	4,200,000.00	3,890,040.00	
FRTR 0.75 05/25/28	3,100,000.00	2,859,595.00	
FRTR 0.75 05/25/52	3,000,000.00	1,629,270.00	
FRTR 0.75 11/25/28	3,400,000.00	3,109,368.00	
FRTR 1 05/25/27	2,000,000.00	1,891,520.00	
FRTR 1 11/25/25	800,000.00	772,672.00	
FRTR 1.25 05/25/34	1,200,000.00	1,027,140.00	
FRTR 1.25 05/25/36	2,750,000.00	2,262,480.00	
FRTR 1.25 05/25/38	900,000.00	710,046.00	
FRTR 1.5 05/25/31	3,050,000.00	2,808,714.50	
FRTR 1.5 05/25/50	2,400,000.00	1,660,368.00	
FRTR 1.75 05/25/66	800,000.00	543,264.00	
FRTR 1.75 06/25/39	2,700,000.00	2,263,464.00	
FRTR 2 05/25/48	2,000,000.00	1,581,300.00	
FRTR 2 11/25/32	2,700,000.00	2,533,086.00	
FRTR 2.5 05/25/30	2,600,000.00	2,568,540.00	
FRTR 2.5 05/25/43	1,800,000.00	1,611,450.00	
FRTR 2.5 09/24/26	4,600,000.00	4,555,564.00	
FRTR 2.75 02/25/29	1,100,000.00	1,100,759.00	
FRTR 2.75 10/25/27	2,650,000.00	2,647,588.50	
FRTR 3 05/25/33	1,500,000.00	1,518,540.00	
FRTR 3.25 05/25/45	900,000.00	901,710.00	
FRTR 3.5 04/25/26	1,800,000.00	1,819,422.00	
FRTR 3.5 11/25/33	2,400,000.00	2,523,456.00	
FRTR 4 04/25/55	1,370,000.00	1,548,935.70	
FRTR 4 04/25/60	1,400,000.00	1,604,918.00	
FRTR 4 10/25/38	2,000,000.00	2,214,120.00	
FRTR 4.5 04/25/41	1,900,000.00	2,234,495.00	
FRTR 4.75 04/25/35	800,000.00	935,560.00	
FRTR 5.5 04/25/29	1,650,000.00	1,862,718.00	
FRTR 5.75 10/25/32	400,000.00	487,684.00	
FRTR 6 10/25/25	2,100,000.00	2,192,211.00	
IRISH 0 10/18/31	500,000.00	410,135.00	
IRISH 0.9 05/15/28	500,000.00	466,345.00	
IRISH 1 05/15/26	800,000.00	769,016.00	
IRISH 1.1 05/15/29	500,000.00	463,515.00	
IRISH 1.3 05/15/33	500,000.00	442,790.00	
IRISH 1.35 03/18/31	500,000.00	459,605.00	

IRISH 1.5 05/15/50	500,000.00	358,845.00	
IRISH 1.7 05/15/37	300,000.00	260,364.00	
IRISH 2 02/18/45	1,100,000.00	924,055.00	
IRISH 2.4 05/15/30	600,000.00	591,858.00	
IRISH 2.6 10/18/34	300,000.00	293,937.00	
IRISH 5.4 03/13/25	800,000.00	815,040.00	
NETHER 0 01/15/27	1,300,000.00	1,205,568.00	
NETHER 0 07/15/30	2,200,000.00	1,869,120.00	
NETHER 0.25 07/15/25	930,000.00	895,050.60	
NETHER 0.25 07/15/29	500,000.00	442,330.00	
NETHER 0.5 01/15/40	1,500,000.00	1,063,770.00	
NETHER 0.5 07/15/26	1,300,000.00	1,233,479.00	
NETHER 0.5 07/15/32	1,700,000.00	1,431,349.00	
NETHER 0.75 07/15/27	400,000.00	376,012.00	
NETHER 0.75 07/15/28	1,700,000.00	1,572,313.00	
NETHER 2.5 01/15/33	600,000.00	593,088.00	
NETHER 2.5 07/15/33	500,000.00	492,545.00	
NETHER 2.75 01/15/47	2,300,000.00	2,295,032.00	
NETHER 3.25 01/15/44	200,000.00	213,282.00	
NETHER 3.75 01/15/42	1,300,000.00	1,469,676.00	
NETHER 4 01/15/37	300,000.00	338,928.00	
NETHER 5.5 01/15/28	700,000.00	771,169.00	
OBL 0 04/10/26	2,100,000.00	1,981,833.00	
OBL 0 04/11/25	2,800,000.00	2,703,120.00	
OBL 0 04/16/27	2,200,000.00	2,031,480.00	
OBL 0 10/09/26	2,700,000.00	2,520,720.00	
OBL 0 10/10/25	2,600,000.00	2,481,830.00	
OBL 1.3 10/15/27	300,000.00	287,442.00	
OBL 2.2 04/13/28	600,000.00	592,836.00	
OBL 2.4 10/19/28	1,600,000.00	1,593,296.00	
RAGB 0 02/20/30	1,300,000.00	1,107,080.00	
RAGB 0 02/20/31	1,400,000.00	1,156,708.00	
RAGB 0 04/20/25	230,000.00	221,897.10	
RAGB 0 10/20/40	300,000.00	181,428.00	
RAGB 0.5 02/20/29	550,000.00	493,784.50	
RAGB 0.5 04/20/27	700,000.00	652,652.00	
RAGB 0.75 02/20/28	600,000.00	555,948.00	
RAGB 0.75 03/20/51	900,000.00	524,448.00	
RAGB 0.75 10/20/26	600,000.00	569,298.00	
RAGB 0.85 06/30/20	250,000.00	115,287.50	
RAGB 0.9 02/20/32	1,000,000.00	864,200.00	
RAGB 1.2 10/20/25	1,000,000.00	970,380.00	
RAGB 1.5 02/20/47	700,000.00	519,484.00	
RAGB 1.5 11/02/86	400,000.00	241,200.00	

RAGB 2.4 05/23/34	1,000,000.00	955,890.00	
RAGB 2.9 02/20/33	500,000.00	500,955.00	
RAGB 3.15 06/20/44	500,000.00	503,915.00	
RAGB 3.8 01/26/62	700,000.00	805,574.00	
RAGB 4.15 03/15/37	300,000.00	335,931.00	
RAGB 4.85 03/15/26	800,000.00	828,528.00	
RAGB 6.25 07/15/27	1,000,000.00	1,108,390.00	
RFGB 0 09/15/26	300,000.00	279,348.00	
RFGB 0 09/15/30	400,000.00	335,276.00	
RFGB 0.25 09/15/40	700,000.00	446,950.00	
RFGB 0.5 04/15/26	700,000.00	665,868.00	
RFGB 0.5 09/15/27	500,000.00	462,395.00	
RFGB 0.5 09/15/28	300,000.00	272,037.00	
RFGB 0.5 09/15/29	800,000.00	709,904.00	
RFGB 0.75 04/15/31	800,000.00	697,408.00	
RFGB 1.375 04/15/47	500,000.00	363,230.00	
RFGB 2.625 07/04/42	800,000.00	749,752.00	
RFGB 2.75 04/15/38	200,000.00	192,838.00	
RFGB 2.75 07/04/28	200,000.00	199,946.00	
RFGB 4 07/04/25	300,000.00	302,850.00	
SPGB 0 01/31/27	500,000.00	459,260.00	
SPGB 0 05/31/25	2,600,000.00	2,497,560.00	
SPGB 0.5 04/30/30	1,600,000.00	1,384,240.00	
SPGB 0.5 10/31/31	1,400,000.00	1,162,210.00	
SPGB 0.7 04/30/32	2,000,000.00	1,664,040.00	
SPGB 0.8 07/30/27	1,700,000.00	1,583,516.00	
SPGB 0.8 07/30/29	700,000.00	626,997.00	
SPGB 0.85 07/30/37	800,000.00	579,104.00	
SPGB 1 10/31/50	800,000.00	437,712.00	
SPGB 1.2 10/31/40	1,400,000.00	983,710.00	
SPGB 1.25 10/31/30	2,100,000.00	1,884,771.00	
SPGB 1.3 10/31/26	1,400,000.00	1,340,388.00	
SPGB 1.4 04/30/28	2,000,000.00	1,883,480.00	
SPGB 1.4 07/30/28	1,200,000.00	1,127,124.00	
SPGB 1.45 04/30/29	2,100,000.00	1,956,780.00	
SPGB 1.45 10/31/27	1,800,000.00	1,708,938.00	
SPGB 1.45 10/31/71	400,000.00	198,124.00	
SPGB 1.5 04/30/27	1,500,000.00	1,434,750.00	
SPGB 1.6 04/30/25	1,400,000.00	1,372,868.00	
SPGB 1.85 07/30/35	600,000.00	518,100.00	
SPGB 1.95 04/30/26	2,400,000.00	2,344,008.00	
SPGB 1.95 07/30/30	700,000.00	659,806.00	
SPGB 2.15 10/31/25	1,600,000.00	1,574,736.00	
SPGB 2.35 07/30/33	700,000.00	654,633.00	

	SPGB 2.55 10/31/32	1,600,000.00	1,533,344.00	
	SPGB 2.7 10/31/48	750,000.00	628,867.50	
	SPGB 2.8 05/31/26	1,100,000.00	1,092,795.00	
	SPGB 2.9 10/31/46	1,700,000.00	1,496,493.00	
	SPGB 3.15 04/30/33	1,800,000.00	1,799,352.00	
	SPGB 3.45 07/30/43	700,000.00	676,305.00	
	SPGB 3.45 07/30/66	1,300,000.00	1,193,621.00	
	SPGB 3.55 10/31/33	1,500,000.00	1,543,425.00	
	SPGB 3.9 07/30/39	700,000.00	726,712.00	
	SPGB 4.2 01/31/37	1,050,000.00	1,137,570.00	
	SPGB 4.65 07/30/25	800,000.00	814,120.00	
	SPGB 4.7 07/30/41	1,500,000.00	1,711,725.00	
	SPGB 4.9 07/30/40	1,400,000.00	1,623,776.00	
	SPGB 5.15 10/31/28	1,500,000.00	1,643,640.00	
	SPGB 5.15 10/31/44	1,400,000.00	1,697,360.00	
	SPGB 5.75 07/30/32	1,000,000.00	1,197,180.00	
	SPGB 5.9 07/30/26	500,000.00	531,475.00	
	SPGB 6 01/31/29	1,900,000.00	2,166,190.00	
	ユーロ小計	378,980,000.00	353,195,405.50 (57,422,509,026)	
国債証券合計			177,808,304,042 (177,808,304,042)	
合 計			177,808,304,042 (177,808,304,042)	

(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	45.9%	46.8%
カナダ・ドル	国債証券	29銘柄	2.0%	2.0%
オーストラリア・ドル	国債証券	20銘柄	1.3%	1.4%
シンガポール・ドル	国債証券	10銘柄	0.4%	0.4%
ニュージーランド・ドル	国債証券	8銘柄	0.2%	0.3%
イギリス・ポンド	国債証券	50銘柄	5.2%	5.2%
イスラエル・シェケル	国債証券	7銘柄	0.3%	0.3%
デンマーク・クローネ	国債証券	7銘柄	0.3%	0.3%
ノルウェー・クローネ	国債証券	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	10銘柄	0.9%	0.9%
オフショア・人民元	国債証券	31銘柄	8.6%	8.7%
マレーシア・リングギット	国債証券	10銘柄	0.5%	0.5%
ポーランド・ズロチ	国債証券	7銘柄	0.5%	0.6%
ユーロ	国債証券	288銘柄	31.7%	32.3%

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

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3月18日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	36,597,345
金銭信託	3,984,239
コール・ローン	148,645,792
国債証券	20,734,040,068
派生商品評価勘定	5,143,435
未収利息	150,185,004
前払費用	19,009,970
流動資産合計	21,097,605,853
資産合計	
21,097,605,853	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	51,665,776
未払解約金	35,887,000
その他未払費用	139
流動負債合計	87,552,915
負債合計	
87,552,915	
純資産の部	
元本等	
元本	17,274,485,812
剰余金	
剰余金又は欠損金 ()	3,735,567,126
元本等合計	21,010,052,938
純資産合計	
21,010,052,938	
負債純資産合計	
21,097,605,853	

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年3月24日 至 2024年3月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p>

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項 目	(2024年3月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	17,274,485,812口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2162円 (1万口当たりの純資産額12,162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3月24日 至 2024年3月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、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3月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2024年3月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	9,755,472,372	-	9,754,600,600	871,772
	カナダ・ドル	419,677,271	-	420,128,566	451,295
	オーストラリア・ド ル	283,466,504	-	285,389,412	1,922,908
	シンガポール・ドル	191,893,573	-	192,620,968	727,395
	ニュージーランド・ ドル	51,723,664	-	51,669,759	53,905
	イギリス・ポンド	1,077,912,737	-	1,084,751,668	6,838,931
	イスラエル・シュケ ル	71,791,814	-	69,766,640	2,025,174
	デンマーク・クロー ネ	55,874,888	-	56,144,928	270,040
	ノルウェー・クロー ネ	37,970,997	-	37,927,170	43,827
	スウェーデン・ク ローナ	44,535,764	-	44,394,339	141,425
	メキシコ・ペソ	188,511,174	-	192,836,904	4,325,730
	オフショア・人民元	1,837,340,954	-	1,835,337,504	2,003,450
	ポーランド・ズロチ	115,356,843	-	116,342,517	985,674
	ユーロ	6,687,541,519	-	6,723,681,440	36,139,921
	小計	20,819,070,074	-	20,865,592,415	46,522,341
	合 計	20,819,070,074	-	20,865,592,415	46,522,341

(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3月24日 至 2024年3月18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3月18日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	18,529,239,574円
同期中における追加設定元本額	12,814,918,336円
同期中における一部解約元本額	14,069,672,098円
2024年3月18日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	1,760,175,203円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	599,388,293円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	9,479,909円
イオン・バランス戦略ファンド	727,196,150円
三井住友・資産最適化ファンド（1 安定重視型）	1,518,456,609円
三井住友・資産最適化ファンド（2 やや安定型）	707,294,808円
三井住友・資産最適化ファンド（3 バランス型）	1,437,311,160円
三井住友・資産最適化ファンド（4 やや成長型）	418,450,282円
三井住友・資産最適化ファンド（5 成長重視型）	72,324,019円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	104,830,985円
日興FWS・先進国債インデックス（為替ヘッジあり）	381,397,526円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）	6,689,979円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）	47,451,604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）	141,267,544円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）	48,832,543円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5（積極成長型）	4,679,684円
SMAM・年金グローバル債券ファンド＜適格機関投資家限定＞	1,016,449,500円
SMAM・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞	6,033,676,399円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	682,283,481円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04＜適格機関投資家限定＞	444,023,155円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞	709,048,602円
SMDAM・年金Wリスクコントロールファンド（リスク3%）＜適格機関投資家限定＞	403,778,377円
合 計	17,274,485,812円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
-----	-----	-----	------	-----	----

国債証券	アメリカ・ドル	T 0.25 05/31/25	370,000.00	349,661.10	
		T 0.25 06/30/25	650,000.00	612,319.50	
		T 0.25 07/31/25	350,000.00	328,478.50	
		T 0.25 08/31/25	590,000.00	551,933.20	
		T 0.25 09/30/25	290,000.00	270,309.00	
		T 0.25 10/31/25	420,000.00	390,230.40	
		T 0.375 01/31/26	570,000.00	525,557.10	
		T 0.375 04/30/25	520,000.00	494,078.00	
		T 0.375 07/31/27	400,000.00	349,288.00	
		T 0.375 09/30/27	470,000.00	407,908.30	
		T 0.375 11/30/25	510,000.00	473,234.10	
		T 0.375 12/31/25	500,000.00	462,565.00	
		T 0.5 02/28/26	550,000.00	507,006.50	
		T 0.5 03/31/25	60,000.00	57,274.20	
		T 0.5 05/31/27	360,000.00	317,422.80	
		T 0.5 06/30/27	310,000.00	272,688.40	
		T 0.5 08/31/27	340,000.00	297,347.00	
		T 0.5 10/31/27	400,000.00	347,632.00	
		T 0.625 03/31/27	120,000.00	106,950.00	
		T 0.625 05/15/30	300,000.00	240,321.00	
		T 0.625 07/31/26	710,000.00	646,930.70	
		T 0.625 08/15/30	750,000.00	595,657.50	
		T 0.625 11/30/27	280,000.00	243,860.40	
		T 0.625 12/31/27	350,000.00	303,950.50	
		T 0.75 01/31/28	460,000.00	400,439.20	
		T 0.75 03/31/26	530,000.00	489,831.30	
		T 0.75 04/30/26	500,000.00	460,700.00	
		T 0.75 05/31/26	430,000.00	395,075.40	
		T 0.75 08/31/26	460,000.00	419,253.20	
		T 0.875 06/30/26	390,000.00	358,601.10	
		T 0.875 09/30/26	540,000.00	492,706.80	
		T 0.875 11/15/30	710,000.00	570,115.80	
		T 1.125 02/15/31	530,000.00	430,974.80	
		T 1.125 02/28/27	30,000.00	27,211.50	
		T 1.125 02/29/28	540,000.00	476,123.40	
		T 1.125 05/15/40	230,000.00	141,049.80	
		T 1.125 08/15/40	210,000.00	127,581.30	
		T 1.125 08/31/28	650,000.00	565,064.50	
		T 1.125 10/31/26	130,000.00	119,009.80	
		T 1.25 03/31/28	460,000.00	406,621.60	
T 1.25 04/30/28	280,000.00	246,951.60			
T 1.25 05/15/50	500,000.00	250,770.00			
T 1.25 05/31/28	580,000.00	510,521.80			
T 1.25 06/30/28	330,000.00	289,832.40			

T 1.25 08/15/31	620,000.00	500,513.60	
T 1.25 09/30/28	570,000.00	497,211.00	
T 1.25 11/30/26	420,000.00	384,938.40	
T 1.25 12/31/26	850,000.00	777,809.50	
T 1.375 08/15/50	450,000.00	233,235.00	
T 1.375 08/31/26	240,000.00	222,237.60	
T 1.375 10/31/28	500,000.00	437,830.00	
T 1.375 11/15/31	640,000.00	518,156.80	
T 1.375 11/15/40	50,000.00	31,564.00	
T 1.375 12/31/28	510,000.00	444,760.80	
T 1.5 02/15/30	570,000.00	486,335.40	
T 1.5 11/30/28	380,000.00	334,107.40	
T 1.625 05/15/26	120,000.00	112,546.80	
T 1.625 05/15/31	580,000.00	484,694.40	
T 1.625 08/15/29	220,000.00	191,969.80	
T 1.625 09/30/26	110,000.00	102,348.40	
T 1.625 11/15/50	140,000.00	77,625.80	
T 1.625 11/30/26	350,000.00	324,166.50	
T 1.75 01/31/29	450,000.00	398,916.00	
T 1.75 08/15/41	210,000.00	139,112.40	
T 1.875 02/15/32	650,000.00	544,219.00	
T 1.875 02/15/41	320,000.00	219,104.00	
T 1.875 02/15/51	390,000.00	230,591.40	
T 1.875 02/28/27	100,000.00	92,740.00	
T 1.875 02/28/29	230,000.00	204,815.00	
T 1.875 06/30/26	200,000.00	188,202.00	
T 1.875 11/15/51	470,000.00	276,472.80	
T 2 02/15/50	570,000.00	350,749.50	
T 2 08/15/51	230,000.00	139,920.50	
T 2 11/15/26	490,000.00	458,654.70	
T 2 11/15/41	170,000.00	117,087.50	
T 2.125 05/31/26	320,000.00	303,142.40	
T 2.25 02/15/52	300,000.00	193,773.00	
T 2.25 05/15/41	220,000.00	159,717.80	
T 2.25 08/15/46	250,000.00	168,320.00	
T 2.375 02/15/42	200,000.00	146,156.00	
T 2.375 03/31/29	90,000.00	81,998.10	
T 2.375 04/30/26	50,000.00	47,679.50	
T 2.375 05/15/29	100,000.00	90,941.00	
T 2.375 05/15/51	590,000.00	393,358.90	
T 2.375 11/15/49	180,000.00	121,150.80	
T 2.5 02/15/45	220,000.00	158,307.60	
T 2.5 02/15/46	220,000.00	156,530.00	
T 2.5 05/15/46	230,000.00	163,290.80	

T 2.625 01/31/26	230,000.00	221,310.60	
T 2.625 04/15/25	700,000.00	682,500.00	
T 2.625 05/31/27	280,000.00	264,479.60	
T 2.625 07/31/29	420,000.00	385,698.60	
T 2.625 12/31/25	110,000.00	105,968.50	
T 2.75 02/15/28	420,000.00	394,938.60	
T 2.75 04/30/27	90,000.00	85,450.50	
T 2.75 05/15/25	190,000.00	185,193.00	
T 2.75 05/31/29	300,000.00	277,821.00	
T 2.75 07/31/27	350,000.00	331,219.00	
T 2.75 08/15/32	280,000.00	249,040.40	
T 2.75 08/15/42	230,000.00	177,849.80	
T 2.75 08/15/47	250,000.00	184,177.50	
T 2.75 11/15/47	250,000.00	183,890.00	
T 2.875 04/30/29	100,000.00	93,269.00	
T 2.875 05/15/32	610,000.00	549,353.80	
T 2.875 05/15/43	290,000.00	226,771.30	
T 2.875 05/15/49	410,000.00	306,999.80	
T 2.875 05/15/52	520,000.00	386,807.20	
T 2.875 06/15/25	420,000.00	409,424.40	
T 2.875 07/31/25	300,000.00	291,942.00	
T 2.875 08/15/28	300,000.00	281,922.00	
T 2.875 08/15/45	110,000.00	84,288.60	
T 3 02/15/48	360,000.00	277,171.20	
T 3 02/15/49	370,000.00	283,945.40	
T 3 05/15/45	290,000.00	227,621.00	
T 3 05/15/47	300,000.00	232,113.00	
T 3 07/15/25	610,000.00	594,792.70	
T 3 08/15/52	160,000.00	122,177.60	
T 3 09/30/25	620,000.00	602,925.20	
T 3 11/15/44	220,000.00	173,342.40	
T 3.125 02/15/42	150,000.00	123,720.00	
T 3.125 05/15/48	420,000.00	330,666.00	
T 3.125 08/15/44	320,000.00	257,923.20	
T 3.125 08/31/27	430,000.00	411,630.40	
T 3.125 08/31/29	220,000.00	207,009.00	
T 3.125 11/15/28	100,000.00	94,767.00	
T 3.125 11/15/41	210,000.00	173,922.00	
T 3.25 05/15/42	370,000.00	309,360.70	
T 3.25 06/30/27	100,000.00	96,273.00	
T 3.25 06/30/29	430,000.00	407,769.00	
T 3.375 05/15/33	720,000.00	668,570.40	
T 3.375 05/15/44	300,000.00	252,021.00	
T 3.375 08/15/42	330,000.00	280,344.90	

T 3.375 11/15/48	300,000.00	246,873.00	
T 3.5 01/31/28	470,000.00	454,513.50	
T 3.5 01/31/30	500,000.00	478,095.00	
T 3.5 02/15/33	1,020,000.00	957,861.60	
T 3.5 02/15/39	50,000.00	45,270.50	
T 3.5 04/30/28	800,000.00	772,776.00	
T 3.625 02/15/44	270,000.00	235,920.60	
T 3.625 02/15/53	150,000.00	129,615.00	
T 3.625 03/31/28	730,000.00	708,749.70	
T 3.625 03/31/30	940,000.00	904,007.40	
T 3.625 05/15/26	710,000.00	694,813.10	
T 3.625 05/15/53	250,000.00	216,185.00	
T 3.625 05/31/28	400,000.00	388,148.00	
T 3.625 08/15/43	230,000.00	201,406.40	
T 3.875 01/15/26	390,000.00	383,865.30	
T 3.875 02/15/43	250,000.00	227,495.00	
T 3.875 03/31/25	470,000.00	464,425.80	
T 3.875 04/30/25	700,000.00	691,397.00	
T 3.875 05/15/43	650,000.00	590,492.50	
T 3.875 08/15/33	800,000.00	772,184.00	
T 3.875 08/15/40	40,000.00	37,211.60	
T 3.875 09/30/29	200,000.00	195,338.00	
T 3.875 11/30/27	410,000.00	401,927.10	
T 3.875 11/30/29	440,000.00	429,488.40	
T 3.875 12/31/27	650,000.00	637,136.50	
T 3.875 12/31/29	500,000.00	487,860.00	
T 4 01/15/27	900,000.00	887,022.00	
T 4 01/31/29	300,000.00	295,452.00	
T 4 02/15/26	640,000.00	631,372.80	
T 4 02/28/30	770,000.00	755,770.40	
T 4 02/29/28	600,000.00	590,760.00	
T 4 06/30/28	370,000.00	364,268.70	
T 4 10/31/29	300,000.00	294,765.00	
T 4 11/15/42	300,000.00	278,355.00	
T 4 11/15/52	380,000.00	351,674.80	
T 4 12/15/25	300,000.00	295,950.00	
T 4.125 07/31/28	170,000.00	168,203.10	
T 4.125 08/15/53	930,000.00	880,226.40	
T 4.125 09/30/27	350,000.00	346,094.00	
T 4.125 10/31/27	470,000.00	464,674.90	
T 4.125 11/15/32	730,000.00	719,188.70	
T 4.25 05/15/39	70,000.00	68,878.60	
T 4.25 05/31/25	820,000.00	812,833.20	
T 4.25 11/15/40	140,000.00	136,081.40	

	T 4.375 05/15/40	140,000.00	138,776.40	
	T 4.375 08/15/43	500,000.00	486,480.00	
	T 4.375 11/15/39	80,000.00	79,559.20	
	T 4.5 02/15/36	50,000.00	51,429.50	
	T 4.5 07/15/26	750,000.00	747,622.50	
	T 4.5 11/15/25	400,000.00	397,828.00	
	T 4.5 11/15/33	530,000.00	537,202.70	
	T 4.625 02/15/40	100,000.00	102,150.00	
	T 4.625 03/15/26	600,000.00	598,920.00	
	T 4.625 06/30/25	500,000.00	497,945.00	
	T 4.625 09/30/30	470,000.00	477,294.40	
	T 4.75 07/31/25	170,000.00	169,603.90	
	アメリカ・ドル小計	72,770,000.00	64,905,859.30 (9,691,742,911)	
カナダ・ドル	CAN 0.25 03/01/26	70,000.00	64,937.60	
	CAN 0.5 09/01/25	180,000.00	170,269.20	
	CAN 0.5 12/01/30	170,000.00	139,486.70	
	CAN 1 06/01/27	140,000.00	128,585.80	
	CAN 1.25 03/01/25	20,000.00	19,377.60	
	CAN 1.25 03/01/27	120,000.00	111,354.00	
	CAN 1.25 06/01/30	150,000.00	131,035.50	
	CAN 1.5 06/01/26	20,000.00	18,923.80	
	CAN 1.5 06/01/31	290,000.00	252,389.90	
	CAN 1.5 12/01/31	60,000.00	51,721.80	
	CAN 1.75 12/01/53	270,000.00	186,975.00	
	CAN 2 06/01/28	60,000.00	56,248.20	
	CAN 2 06/01/32	370,000.00	329,218.60	
	CAN 2 12/01/51	240,000.00	178,975.20	
	CAN 2.25 06/01/25	70,000.00	68,157.60	
	CAN 2.25 06/01/29	60,000.00	56,422.20	
	CAN 2.25 12/01/29	160,000.00	149,812.80	
	CAN 2.5 12/01/32	110,000.00	101,348.50	
	CAN 2.75 06/01/33	230,000.00	215,645.70	
	CAN 2.75 09/01/27	10,000.00	9,678.40	
	CAN 2.75 12/01/48	30,000.00	26,562.60	
	CAN 3 04/01/26	200,000.00	195,552.00	
	CAN 3 10/01/25	330,000.00	323,149.20	
	CAN 3.25 09/01/28	180,000.00	177,030.00	
	CAN 3.5 03/01/28	80,000.00	79,440.00	
	CAN 3.5 12/01/45	90,000.00	90,360.00	
CAN 3.75 05/01/25	30,000.00	29,727.90		
CAN 4.5 11/01/25	250,000.00	250,455.00		
CAN 5 06/01/37	110,000.00	126,749.70		
CANADA 2.75 12/01/64	50,000.00	43,445.00		

	カナダ・ドル小計	4,150,000.00	3,783,035.50 (417,079,664)	
オーストラ リア・ドル	ACGB 0.25 11/21/25	200,000.00	188,368.00	
	ACGB 0.5 09/21/26	200,000.00	184,628.00	
	ACGB 1 11/21/31	270,000.00	216,380.70	
	ACGB 1 12/21/30	150,000.00	123,930.00	
	ACGB 1.25 05/21/32	240,000.00	193,298.40	
	ACGB 1.5 06/21/31	190,000.00	160,358.10	
	ACGB 1.75 06/21/51	230,000.00	130,573.30	
	ACGB 1.75 11/21/32	200,000.00	165,920.00	
	ACGB 2.75 05/21/41	60,000.00	47,976.00	
	ACGB 2.75 06/21/35	50,000.00	43,599.00	
	ACGB 2.75 11/21/27	220,000.00	212,489.20	
	ACGB 2.75 11/21/28	140,000.00	133,810.60	
	ACGB 2.75 11/21/29	200,000.00	188,784.00	
	ACGB 3 03/21/47	80,000.00	62,756.80	
	ACGB 3 11/21/33	80,000.00	72,830.40	
	ACGB 3.25 04/21/25	20,000.00	19,831.20	
	ACGB 3.25 04/21/29	130,000.00	126,591.40	
	ACGB 3.5 12/21/34	190,000.00	179,135.80	
	ACGB 3.75 04/21/37	90,000.00	85,447.80	
	ACGB 3.75 05/21/34	150,000.00	145,131.00	
ACGB 4.25 04/21/26	130,000.00	131,202.50		
ACGB 4.75 04/21/27	80,000.00	82,328.00		
	オーストラリア・ドル小計	3,300,000.00	2,895,370.20 (283,601,511)	
シンガポ ール・ドル	SIGB 0.5 11/01/25	70,000.00	66,771.60	
	SIGB 1.875 03/01/50	140,000.00	111,580.00	
	SIGB 1.875 10/01/51	30,000.00	23,656.50	
	SIGB 2.125 06/01/26	190,000.00	185,174.00	
	SIGB 2.25 08/01/36	250,000.00	228,875.00	
	SIGB 2.375 06/01/25	50,000.00	49,310.00	
	SIGB 2.375 07/01/39	120,000.00	109,951.20	
	SIGB 2.625 05/01/28	200,000.00	196,480.00	
	SIGB 2.75 03/01/46	40,000.00	38,240.00	
	SIGB 2.875 07/01/29	150,000.00	148,575.00	
	SIGB 2.875 09/01/30	260,000.00	256,672.00	
	SIGB 3 08/01/72	30,000.00	29,985.00	
	SIGB 3.375 09/01/33	270,000.00	276,374.70	
	シンガポール・ドル小計	1,800,000.00	1,721,645.00 (192,049,500)	
ニュージ ーランド・ド ル	NZGB 0.25 05/15/28	150,000.00	126,195.00	
	NZGB 0.5 05/15/26	110,000.00	100,554.30	
	NZGB 1.75 05/15/41	30,000.00	18,983.70	

	NZGB 2 05/15/32	180,000.00	148,460.40	
	NZGB 2.75 04/15/25	30,000.00	29,211.60	
	NZGB 2.75 04/15/37	80,000.00	63,843.20	
	NZGB 2.75 05/15/51	30,000.00	20,249.40	
	NZGB 4.5 05/15/30	60,000.00	59,995.80	
	ニュージーランド・ドル小計	670,000.00	567,493.40 (51,579,475)	
イギリス・ ボンド	UK TSY GILT 1.125 01/31/39	110,000.00	71,291.00	
	UKT 0.125 01/30/26	320,000.00	296,192.00	
	UKT 0.125 01/31/28	50,000.00	43,022.50	
	UKT 0.25 07/31/31	120,000.00	91,794.00	
	UKT 0.375 10/22/26	270,000.00	244,622.70	
	UKT 0.375 10/22/30	100,000.00	79,482.00	
	UKT 0.5 01/31/29	250,000.00	211,597.50	
	UKT 0.5 10/22/61	140,000.00	42,376.60	
	UKT 0.625 07/31/35	370,000.00	252,525.00	
	UKT 0.625 10/22/50	80,000.00	32,536.00	
	UKT 0.875 01/31/46	220,000.00	110,066.00	
	UKT 0.875 10/22/29	100,000.00	84,701.00	
	UKT 1 01/31/32	170,000.00	135,935.40	
	UKT 1.125 10/22/73	90,000.00	33,399.00	
	UKT 1.25 07/22/27	130,000.00	118,530.10	
	UKT 1.25 07/31/51	90,000.00	44,406.00	
	UKT 1.25 10/22/41	340,000.00	209,066.00	
	UKT 1.5 07/22/26	110,000.00	103,400.00	
	UKT 1.5 07/22/47	110,000.00	62,557.00	
	UKT 1.5 07/31/53	20,000.00	10,312.40	
	UKT 1.625 10/22/28	70,000.00	63,173.60	
	UKT 1.625 10/22/71	130,000.00	60,827.00	
	UKT 1.75 01/22/49	90,000.00	53,256.60	
	UKT 1.75 07/22/57	120,000.00	64,524.00	
	UKT 1.75 09/07/37	170,000.00	126,214.80	
	UKT 2 09/07/25	110,000.00	106,041.10	
	UKT 2.5 07/22/65	120,000.00	77,150.40	
	UKT 3.25 01/22/44	90,000.00	75,261.60	
	UKT 3.25 01/31/33	500,000.00	471,090.00	
	UKT 3.5 01/22/45	120,000.00	103,698.00	
	UKT 3.5 07/22/68	140,000.00	116,186.00	
	UKT 3.5 10/22/25	200,000.00	196,682.00	
	UKT 3.75 01/29/38	150,000.00	140,961.00	
UKT 3.75 07/22/52	40,000.00	35,228.00		
UKT 3.75 10/22/53	380,000.00	332,899.00		
UKT 4 01/22/60	110,000.00	101,255.00		
UKT 4.125 01/29/27	80,000.00	79,664.00		

	UKT 4.25 03/07/36	180,000.00	180,919.80	
	UKT 4.25 06/07/32	140,000.00	142,835.00	
	UKT 4.25 09/07/39	80,000.00	78,870.40	
	UKT 4.25 12/07/27	80,000.00	80,410.40	
	UKT 4.25 12/07/49	90,000.00	86,330.70	
	UKT 4.5 06/07/28	160,000.00	162,345.60	
	UKT 4.5 09/07/34	30,000.00	30,945.90	
	UKT 4.5 12/07/42	50,000.00	50,245.00	
	UKT 4.75 10/22/43	70,000.00	72,275.00	
	UKT 4.75 12/07/30	110,000.00	115,153.50	
	UKT 4.75 12/07/38	110,000.00	114,805.90	
	UKT 6 12/07/28	100,000.00	108,591.00	
	イギリス・ポンド小計	7,010,000.00	5,705,652.50 (1,084,815,710)	
イスラエル・シュケル	ILGOV 0.5 02/27/26	290,000.00	271,724.20	
	ILGOV 0.5 04/30/25	210,000.00	202,366.50	
	ILGOV 1 03/31/30	170,000.00	142,250.90	
	ILGOV 1.3 04/30/32	170,000.00	136,010.20	
	ILGOV 1.5 05/31/37	220,000.00	153,707.40	
	ILGOV 1.75 08/31/25	150,000.00	145,510.50	
	ILGOV 2 03/31/27	90,000.00	85,061.70	
	ILGOV 2.25 09/28/28	160,000.00	148,435.20	
	ILGOV 2.8 11/29/52	170,000.00	115,810.80	
	ILGOV 3.75 03/31/47	200,000.00	171,378.00	
	ILGOV 6.25 10/30/26	110,000.00	116,288.70	
	イスラエル・シュケル小計	1,940,000.00	1,688,544.10 (68,652,488)	
デンマーク・クローネ	DGB 0 11/15/31	230,000.00	192,443.30	
	DGB 0.25 11/15/52	410,000.00	222,047.80	
	DGB 0.5 11/15/27	440,000.00	409,890.80	
	DGB 0.5 11/15/29	670,000.00	603,830.80	
	DGB 1.75 11/15/25	340,000.00	333,818.80	
	DGB 4.5 11/15/39	650,000.00	808,821.00	
	デンマーク・クローネ小計	2,740,000.00	2,570,852.50 (56,044,586)	
ノルウェー・クローネ	NGB 1.25 09/17/31	390,000.00	330,189.60	
	NGB 1.375 08/19/30	180,000.00	157,620.60	
	NGB 1.5 02/19/26	370,000.00	354,082.60	
	NGB 1.75 02/17/27	290,000.00	274,690.90	
	NGB 1.75 03/13/25	330,000.00	322,119.60	
	NGB 1.75 09/06/29	170,000.00	154,747.60	
	NGB 2 04/26/28	290,000.00	272,179.50	
	NGB 2.125 05/18/32	200,000.00	178,828.00	
	NGB 3 08/15/33	680,000.00	645,809.60	

ノルウェー・クローネ小計		2,900,000.00	2,690,268.00 (37,878,973)	
スウェーデン・クローナ	SGB 0.125 05/12/31	380,000.00	324,387.00	
	SGB 0.75 05/12/28	520,000.00	485,352.40	
	SGB 0.75 11/12/29	770,000.00	705,751.20	
	SGB 1 11/12/26	860,000.00	823,269.40	
	SGB 1.75 11/11/33	110,000.00	103,922.50	
	SGB 2.25 06/01/32	200,000.00	198,032.00	
	SGB 2.5 05/12/25	120,000.00	119,002.80	
	SGB 3.5 03/30/39	290,000.00	323,393.50	
スウェーデン・クローナ小計		3,250,000.00	3,083,110.80 (44,396,797)	
メキシコ・ペソ	MBONO 5 03/06/25	500,000.00	475,900.00	
	MBONO 5.5 03/04/27	1,500,000.00	1,344,675.00	
	MBONO 5.75 03/05/26	3,800,000.00	3,514,354.00	
	MBONO 7.5 05/26/33	2,400,000.00	2,146,656.00	
	MBONO 7.5 06/03/27	2,800,000.00	2,645,384.00	
	MBONO 7.75 05/29/31	1,000,000.00	923,660.00	
	MBONO 7.75 11/13/42	1,400,000.00	1,197,462.00	
	MBONO 7.75 11/23/34	920,000.00	826,261.20	
	MBONO 8 11/07/47	3,100,000.00	2,691,668.00	
	MBONO 8.5 05/31/29	3,700,000.00	3,591,886.00	
MBONO 8.5 11/18/38	1,900,000.00	1,777,412.00		
メキシコ・ペソ小計		23,020,000.00	21,135,318.20 (188,913,815)	
オフショア・人民元	CGB 2.18 08/15/26	6,000,000.00	6,001,980.00	
	CGB 2.18 08/25/25	5,600,000.00	5,609,968.00	
	CGB 2.24 05/25/25	1,000,000.00	1,002,650.00	
	CGB 2.28 11/25/25	4,800,000.00	4,815,600.00	
	CGB 2.3 05/15/26	6,400,000.00	6,421,504.00	
	CGB 2.4 07/15/28	2,300,000.00	2,310,971.00	
	CGB 2.44 10/15/27	900,000.00	905,805.00	
	CGB 2.46 02/15/26	3,600,000.00	3,623,076.00	
	CGB 2.48 04/15/27	2,800,000.00	2,823,072.00	
	CGB 2.48 09/25/28	3,500,000.00	3,530,310.00	
	CGB 2.6 09/15/30	3,800,000.00	3,851,908.00	
	CGB 2.62 06/25/30	1,900,000.00	1,926,657.00	
	CGB 2.64 01/15/28	4,400,000.00	4,460,500.00	
	CGB 2.67 05/25/33	6,200,000.00	6,327,162.00	
	CGB 2.69 08/12/26	1,200,000.00	1,214,712.00	
	CGB 2.79 12/15/29	2,800,000.00	2,866,920.00	
	CGB 2.8 03/25/30	5,600,000.00	5,735,352.00	
CGB 2.8 11/15/32	4,200,000.00	4,322,304.00		
CGB 2.91 10/14/28	3,500,000.00	3,599,295.00		

	CGB 3.02 05/27/31	2,800,000.00	2,917,908.00	
	CGB 3.03 03/11/26	1,300,000.00	1,324,895.00	
	CGB 3.12 10/25/52	2,800,000.00	3,064,796.00	
	CGB 3.19 04/15/53	2,600,000.00	2,938,702.00	
	CGB 3.69 05/17/28	2,000,000.00	2,138,840.00	
	CGB 3.72 04/12/51	3,100,000.00	3,736,120.00	
	オフショア・人民元小計	85,100,000.00	87,471,007.00 (1,812,058,128)	
ポーランド・ズロチ	POLGB 0.25 10/25/26	300,000.00	265,455.00	
	POLGB 0.75 04/25/25	670,000.00	640,198.40	
	POLGB 1.25 10/25/30	610,000.00	476,281.90	
	POLGB 1.75 04/25/32	170,000.00	130,305.00	
	POLGB 2.5 07/25/27	240,000.00	220,972.80	
	POLGB 2.75 04/25/28	50,000.00	45,601.50	
	POLGB 2.75 10/25/29	480,000.00	423,326.40	
	POLGB 3.75 05/25/27	130,000.00	124,871.50	
	POLGB 6 10/25/33	120,000.00	124,948.80	
	POLGB 7.5 07/25/28	530,000.00	575,320.30	
	ポーランド・ズロチ小計	3,300,000.00	3,027,281.60 (114,343,152)	
ユーロ	BGB 0 10/22/27	50,000.00	45,360.50	
	BGB 0 10/22/31	10,000.00	8,113.50	
	BGB 0.1 06/22/30	90,000.00	76,586.40	
	BGB 0.35 06/22/32	300,000.00	245,835.00	
	BGB 0.4 06/22/40	100,000.00	64,680.00	
	BGB 0.65 06/22/71	30,000.00	12,834.30	
	BGB 0.8 06/22/25	190,000.00	184,123.30	
	BGB 0.8 06/22/27	100,000.00	93,891.00	
	BGB 0.8 06/22/28	170,000.00	157,153.10	
	BGB 0.9 06/22/29	130,000.00	118,704.30	
	BGB 1.25 04/22/33	100,000.00	87,501.00	
	BGB 1.4 06/22/53	140,000.00	89,770.80	
	BGB 1.45 06/22/37	20,000.00	16,451.00	
	BGB 1.6 06/22/47	100,000.00	72,351.00	
	BGB 1.7 06/22/50	30,000.00	21,468.60	
	BGB 1.9 06/22/38	60,000.00	51,490.20	
	BGB 2.75 04/22/39	70,000.00	66,579.10	
	BGB 3 06/22/34	140,000.00	140,789.60	
	BGB 3.45 06/22/43	270,000.00	276,093.90	
	BGB 3.75 06/22/45	100,000.00	106,846.00	
	BGB 4 03/28/32	130,000.00	141,065.60	
	BGB 4.5 03/28/26	90,000.00	92,678.40	
	BGB 5.5 03/28/28	80,000.00	88,386.40	
BKO 2.5 03/13/25	290,000.00	287,421.90		

BKO 2.8 06/12/25	200,000.00	198,812.00	
BKO 3.1 09/18/25	140,000.00	139,897.80	
BTPS 0 04/01/26	60,000.00	56,154.60	
BTPS 0 08/01/26	200,000.00	185,398.00	
BTPS 0.25 03/15/28	180,000.00	160,453.80	
BTPS 0.45 02/15/29	20,000.00	17,503.40	
BTPS 0.5 02/01/26	360,000.00	341,841.60	
BTPS 0.6 08/01/31	100,000.00	81,820.00	
BTPS 0.85 01/15/27	120,000.00	112,494.00	
BTPS 0.9 04/01/31	110,000.00	92,948.90	
BTPS 0.95 06/01/32	180,000.00	147,769.20	
BTPS 0.95 08/01/30	520,000.00	448,744.40	
BTPS 0.95 09/15/27	210,000.00	194,840.10	
BTPS 0.95 12/01/31	100,000.00	83,266.00	
BTPS 1.1 04/01/27	140,000.00	131,628.00	
BTPS 1.35 04/01/30	170,000.00	151,825.30	
BTPS 1.45 03/01/36	20,000.00	15,511.80	
BTPS 1.5 04/30/45	130,000.00	83,694.00	
BTPS 1.5 06/01/25	130,000.00	127,003.50	
BTPS 1.6 06/01/26	130,000.00	125,512.40	
BTPS 1.65 03/01/32	20,000.00	17,500.80	
BTPS 1.8 03/01/41	60,000.00	43,718.40	
BTPS 2 02/01/28	190,000.00	182,077.00	
BTPS 2 12/01/25	220,000.00	215,261.20	
BTPS 2.05 08/01/27	160,000.00	154,374.40	
BTPS 2.1 07/15/26	150,000.00	146,226.00	
BTPS 2.15 03/01/72	50,000.00	31,038.50	
BTPS 2.15 09/01/52	100,000.00	67,613.00	
BTPS 2.25 09/01/36	170,000.00	143,592.20	
BTPS 2.45 09/01/50	70,000.00	51,651.60	
BTPS 2.5 11/15/25	20,000.00	19,740.60	
BTPS 2.5 12/01/32	200,000.00	184,704.00	
BTPS 2.65 12/01/27	230,000.00	225,961.20	
BTPS 2.7 03/01/47	150,000.00	119,743.50	
BTPS 2.8 03/01/67	90,000.00	67,448.70	
BTPS 2.8 06/15/29	50,000.00	48,905.50	
BTPS 2.8 12/01/28	20,000.00	19,666.00	
BTPS 2.95 09/01/38	200,000.00	178,302.00	
BTPS 3 08/01/29	120,000.00	118,494.00	
BTPS 3.1 03/01/40	220,000.00	196,457.80	
BTPS 3.25 03/01/38	400,000.00	370,452.00	
BTPS 3.25 09/01/46	90,000.00	79,082.10	
BTPS 3.4 03/28/25	80,000.00	79,860.00	
BTPS 3.4 04/01/28	240,000.00	241,980.00	

BTPS 3.45 03/01/48	10,000.00	9,028.80	
BTPS 3.5 01/15/26	80,000.00	80,243.20	
BTPS 3.6 09/29/25	290,000.00	290,783.00	
BTPS 3.8 04/15/26	260,000.00	262,652.00	
BTPS 3.85 09/01/49	10,000.00	9,574.90	
BTPS 3.85 12/15/29	260,000.00	267,233.20	
BTPS 4 04/30/35	30,000.00	30,717.30	
BTPS 4 10/30/31	120,000.00	124,533.60	
BTPS 4.4 05/01/33	300,000.00	318,816.00	
BTPS 4.45 09/01/43	210,000.00	219,004.80	
BTPS 4.5 03/01/26	130,000.00	132,914.60	
BTPS 4.5 10/01/53	110,000.00	115,207.40	
BTPS 4.75 09/01/28	200,000.00	212,710.00	
BTPS 5 03/01/25	100,000.00	101,286.00	
BTPS 5 08/01/34	250,000.00	277,615.00	
BTPS 5 08/01/39	220,000.00	244,371.60	
BTPS 5 09/01/40	180,000.00	200,183.40	
BTPS 5.25 11/01/29	250,000.00	275,522.50	
BTPS 5.75 02/01/33	240,000.00	279,156.00	
BTPS 6 05/01/31	230,000.00	268,177.70	
BTPS 6.5 11/01/27	190,000.00	211,646.70	
DBR 0 02/15/30	160,000.00	139,206.40	
DBR 0 02/15/31	100,000.00	85,061.00	
DBR 0 02/15/32	190,000.00	157,829.20	
DBR 0 05/15/35	260,000.00	197,709.20	
DBR 0 05/15/36	80,000.00	59,100.00	
DBR 0 08/15/26	220,000.00	206,082.80	
DBR 0 08/15/29	250,000.00	219,875.00	
DBR 0 08/15/30	360,000.00	309,744.00	
DBR 0 08/15/30	110,000.00	94,748.50	
DBR 0 08/15/31	200,000.00	168,224.00	
DBR 0 08/15/31	200,000.00	168,304.00	
DBR 0 08/15/50	100,000.00	51,560.00	
DBR 0 08/15/50	170,000.00	87,946.10	
DBR 0 08/15/52	140,000.00	68,775.00	
DBR 0 11/15/27	220,000.00	200,697.20	
DBR 0 11/15/28	180,000.00	160,893.00	
DBR 0.25 02/15/29	160,000.00	144,062.40	
DBR 0.25 08/15/28	100,000.00	90,904.00	
DBR 0.5 02/15/26	100,000.00	95,592.00	
DBR 0.5 02/15/28	100,000.00	92,645.00	
DBR 1 05/15/38	450,000.00	366,304.50	
DBR 1.25 08/15/48	80,000.00	60,958.40	
DBR 1.7 08/15/32	280,000.00	265,493.20	

DBR 1.8 08/15/53	270,000.00	227,337.30	
DBR 2.1 11/15/29	160,000.00	157,187.20	
DBR 2.3 02/15/33	140,000.00	138,825.40	
DBR 2.3 02/15/33	150,000.00	148,816.50	
DBR 2.5 07/04/44	330,000.00	323,842.20	
DBR 2.5 08/15/46	230,000.00	226,138.30	
DBR 4 01/04/37	140,000.00	162,015.00	
DBR 4.25 07/04/39	90,000.00	108,584.10	
DBR 4.75 07/04/28	170,000.00	185,349.30	
DBR 4.75 07/04/40	160,000.00	205,187.20	
DBR 5.625 01/04/28	160,000.00	177,536.00	
DBR 6.25 01/04/30	130,000.00	156,397.80	
DBR 6.5 07/04/27	90,000.00	100,785.60	
FRTR 0 02/25/26	310,000.00	292,733.00	
FRTR 0 02/25/27	500,000.00	460,810.00	
FRTR 0 03/25/25	390,000.00	376,712.70	
FRTR 0 05/25/32	550,000.00	439,615.00	
FRTR 0 11/25/29	400,000.00	343,756.00	
FRTR 0 11/25/30	500,000.00	418,025.00	
FRTR 0 11/25/31	630,000.00	511,484.40	
FRTR 0.25 11/25/26	150,000.00	140,055.00	
FRTR 0.5 05/25/26	270,000.00	256,305.60	
FRTR 0.5 05/25/29	200,000.00	178,870.00	
FRTR 0.5 05/25/40	290,000.00	193,490.90	
FRTR 0.5 05/25/72	80,000.00	31,453.60	
FRTR 0.5 06/25/44	150,000.00	90,190.50	
FRTR 0.75 02/25/28	330,000.00	305,646.00	
FRTR 0.75 05/25/28	390,000.00	359,755.50	
FRTR 0.75 05/25/52	180,000.00	97,756.20	
FRTR 0.75 11/25/28	370,000.00	338,372.40	
FRTR 1 11/25/25	200,000.00	193,168.00	
FRTR 1.25 05/25/34	110,000.00	94,154.50	
FRTR 1.25 05/25/36	20,000.00	16,454.40	
FRTR 1.25 05/25/38	230,000.00	181,456.20	
FRTR 1.5 05/25/50	230,000.00	159,118.60	
FRTR 1.75 05/25/66	120,000.00	81,489.60	
FRTR 1.75 06/25/39	160,000.00	134,131.20	
FRTR 2 11/25/32	230,000.00	215,781.40	
FRTR 2.5 05/25/30	210,000.00	207,459.00	
FRTR 2.5 05/25/43	670,000.00	599,817.50	
FRTR 2.5 09/24/26	440,000.00	435,749.60	
FRTR 2.75 02/25/29	300,000.00	300,207.00	
FRTR 2.75 10/25/27	470,000.00	469,572.30	
FRTR 3 05/25/54	90,000.00	84,518.10	

FRTR 3 06/25/49	100,000.00	95,647.00	
FRTR 3.25 05/25/45	280,000.00	280,532.00	
FRTR 3.5 04/25/26	240,000.00	242,589.60	
FRTR 3.5 11/25/33	200,000.00	210,288.00	
FRTR 4 04/25/60	60,000.00	68,782.20	
FRTR 4 10/25/38	210,000.00	232,482.60	
FRTR 4.5 04/25/41	280,000.00	329,294.00	
FRTR 4.75 04/25/35	100,000.00	116,945.00	
FRTR 5.5 04/25/29	340,000.00	383,832.80	
FRTR 5.75 10/25/32	140,000.00	170,689.40	
FRTR 6 10/25/25	180,000.00	187,903.80	
IRISH 0 10/18/31	50,000.00	41,013.50	
IRISH 0.2 05/15/27	10,000.00	9,250.70	
IRISH 0.2 10/18/30	80,000.00	68,473.60	
IRISH 0.35 10/18/32	60,000.00	49,350.60	
IRISH 0.9 05/15/28	160,000.00	149,230.40	
IRISH 1 05/15/26	10,000.00	9,612.70	
IRISH 1.1 05/15/29	50,000.00	46,351.50	
IRISH 1.35 03/18/31	60,000.00	55,152.60	
IRISH 1.5 05/15/50	70,000.00	50,238.30	
IRISH 1.7 05/15/37	60,000.00	52,072.80	
IRISH 2.4 05/15/30	80,000.00	78,914.40	
IRISH 3 10/18/43	40,000.00	39,907.60	
IRISH 5.4 03/13/25	50,000.00	50,940.00	
IRISH GOVT 0.55 04/22/41	60,000.00	40,397.40	
NETHER 0 01/15/26	100,000.00	94,802.00	
NETHER 0 01/15/27	110,000.00	102,009.60	
NETHER 0 01/15/29	40,000.00	35,305.60	
NETHER 0 01/15/38	150,000.00	102,129.00	
NETHER 0 01/15/52	80,000.00	38,472.00	
NETHER 0 07/15/30	90,000.00	76,464.00	
NETHER 0.25 07/15/25	140,000.00	134,738.80	
NETHER 0.25 07/15/29	160,000.00	141,545.60	
NETHER 0.5 01/15/40	340,000.00	241,121.20	
NETHER 0.5 07/15/26	100,000.00	94,883.00	
NETHER 0.5 07/15/32	40,000.00	33,678.80	
NETHER 0.75 07/15/27	190,000.00	178,605.70	
NETHER 0.75 07/15/28	150,000.00	138,733.50	
NETHER 2 01/15/54	70,000.00	59,467.80	
NETHER 2.5 01/15/33	100,000.00	98,848.00	
NETHER 2.5 07/15/33	110,000.00	108,359.90	
NETHER 2.75 01/15/47	80,000.00	79,827.20	
NETHER 4 01/15/37	110,000.00	124,273.60	
OBL 0 04/10/26	320,000.00	301,993.60	

OBL 0 04/11/25	150,000.00	144,810.00	
OBL 0 04/16/27	190,000.00	175,446.00	
OBL 0 10/09/26	200,000.00	186,720.00	
OBL 0 10/10/25	100,000.00	95,455.00	
OBL 1.3 10/15/27	390,000.00	373,674.60	
OBL 1.3 10/15/27	70,000.00	67,151.00	
OBL 2.2 04/13/28	250,000.00	247,015.00	
RAGB 0 02/20/30	70,000.00	59,612.00	
RAGB 0 02/20/31	100,000.00	82,622.00	
RAGB 0 04/20/25	80,000.00	77,181.60	
RAGB 0 10/20/28	140,000.00	123,646.60	
RAGB 0 10/20/40	180,000.00	108,856.80	
RAGB 0.25 10/20/36	60,000.00	42,815.40	
RAGB 0.5 02/20/29	110,000.00	98,756.90	
RAGB 0.7 04/20/71	70,000.00	31,748.50	
RAGB 0.75 02/20/28	80,000.00	74,126.40	
RAGB 0.75 10/20/26	60,000.00	56,929.80	
RAGB 0.9 02/20/32	100,000.00	86,420.00	
RAGB 1.5 11/02/86	20,000.00	12,060.00	
RAGB 1.85 05/23/49	170,000.00	133,191.60	
RAGB 2.9 02/20/33	140,000.00	140,267.40	
RAGB 3.15 06/20/44	50,000.00	50,391.50	
RAGB 3.8 01/26/62	20,000.00	23,016.40	
RAGB 4.15 03/15/37	90,000.00	100,779.30	
RAGB 4.85 03/15/26	150,000.00	155,349.00	
RAGB 6.25 07/15/27	80,000.00	88,671.20	
RFGB 0 09/15/26	120,000.00	111,739.20	
RFGB 0 09/15/30	50,000.00	41,909.50	
RFGB 0.125 04/15/36	40,000.00	28,458.00	
RFGB 0.125 04/15/52	60,000.00	27,954.60	
RFGB 0.125 09/15/31	40,000.00	32,902.00	
RFGB 0.25 09/15/40	70,000.00	44,695.00	
RFGB 0.5 04/15/26	70,000.00	66,586.80	
RFGB 0.5 04/15/43	10,000.00	6,314.10	
RFGB 0.5 09/15/28	60,000.00	54,407.40	
RFGB 0.5 09/15/29	50,000.00	44,369.00	
RFGB 0.75 04/15/31	60,000.00	52,305.60	
RFGB 1.125 04/15/34	100,000.00	84,599.00	
RFGB 1.375 04/15/47	10,000.00	7,264.60	
RFGB 1.5 09/15/32	80,000.00	72,028.80	
RFGB 2.625 07/04/42	10,000.00	9,371.90	
SPGB 0 01/31/26	300,000.00	283,149.00	
SPGB 0 01/31/27	110,000.00	101,037.20	
SPGB 0 05/31/25	300,000.00	288,180.00	

SPGB 0.1 04/30/31	240,000.00	196,140.00	
SPGB 0.5 04/30/30	140,000.00	121,121.00	
SPGB 0.5 10/31/31	200,000.00	166,030.00	
SPGB 0.6 10/31/29	100,000.00	88,118.00	
SPGB 0.7 04/30/32	60,000.00	49,921.20	
SPGB 0.8 07/30/27	370,000.00	344,647.60	
SPGB 0.8 07/30/29	100,000.00	89,571.00	
SPGB 0.85 07/30/37	160,000.00	115,820.80	
SPGB 1 07/30/42	300,000.00	196,029.00	
SPGB 1 10/31/50	40,000.00	21,885.60	
SPGB 1.2 10/31/40	290,000.00	203,768.50	
SPGB 1.25 10/31/30	190,000.00	170,526.90	
SPGB 1.4 04/30/28	320,000.00	301,356.80	
SPGB 1.4 07/30/28	190,000.00	178,461.30	
SPGB 1.45 04/30/29	250,000.00	232,950.00	
SPGB 1.45 10/31/27	180,000.00	170,893.80	
SPGB 1.45 10/31/71	90,000.00	44,577.90	
SPGB 1.5 04/30/27	190,000.00	181,735.00	
SPGB 1.6 04/30/25	100,000.00	98,062.00	
SPGB 1.85 07/30/35	20,000.00	17,270.00	
SPGB 1.9 10/31/52	90,000.00	60,920.10	
SPGB 1.95 04/30/26	180,000.00	175,800.60	
SPGB 1.95 07/30/30	210,000.00	197,941.80	
SPGB 2.35 07/30/33	100,000.00	93,519.00	
SPGB 2.55 10/31/32	110,000.00	105,417.40	
SPGB 2.8 05/31/26	290,000.00	288,100.50	
SPGB 3.15 04/30/33	150,000.00	149,946.00	
SPGB 3.45 07/30/43	200,000.00	193,230.00	
SPGB 3.45 07/30/66	130,000.00	119,362.10	
SPGB 3.55 10/31/33	200,000.00	205,790.00	
SPGB 3.9 07/30/39	420,000.00	436,027.20	
SPGB 4.2 01/31/37	130,000.00	140,842.00	
SPGB 4.65 07/30/25	140,000.00	142,471.00	
SPGB 4.7 07/30/41	50,000.00	57,057.50	
SPGB 5.75 07/30/32	70,000.00	83,802.60	
SPGB 6 01/31/29	70,000.00	79,807.00	
ユーロ小計	44,760,000.00	41,154,406.20 (6,690,883,360)	
国債証券合計		20,734,040,068 (20,734,040,068)	
合計		20,734,040,068 (20,734,040,068)	

(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	188銘柄	46.1%	46.7%
カナダ・ドル	国債証券	30銘柄	2.0%	2.0%
オーストラリア・ドル	国債証券	22銘柄	1.3%	1.4%
シンガポール・ドル	国債証券	13銘柄	0.9%	0.9%
ニュージーランド・ドル	国債証券	8銘柄	0.2%	0.2%
イギリス・ポンド	国債証券	49銘柄	5.2%	5.2%
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	6銘柄	0.3%	0.3%
ノルウェー・クローネ	国債証券	9銘柄	0.2%	0.2%
スウェーデン・クローナ	国債証券	8銘柄	0.2%	0.2%
メキシコ・ペソ	国債証券	11銘柄	0.9%	0.9%
オフショア・人民元	国債証券	25銘柄	8.6%	8.7%
ポーランド・ズロチ	国債証券	10銘柄	0.5%	0.6%
ユーロ	国債証券	280銘柄	31.8%	32.3%

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。

米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

(2024年3月18日現在)

資産の部		
流動資産		
預金		77,390,281
金銭信託		1,793,030
コール・ローン		66,895,191
国債証券		7,771,350,142
派生商品評価勘定		399,120
未収入金		4,000,000
未収利息		89,211,586
前払費用		11,189,048
流動資産合計		8,022,228,398
資産合計		8,022,228,398
負債の部		
流動負債		
未払解約金		858,868
その他未払費用		27
流動負債合計		858,895
負債合計		858,895
純資産の部		
元本等		
元本		7,493,553,376
剰余金		
剰余金又は欠損金()		527,816,127
元本等合計		8,021,369,503

純資産合計	8,021,369,503
負債純資産合計	8,022,228,398

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年3月24日 至 2024年3月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2024年3月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	7,493,553,376口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0704円 (1万口当たりの純資産額10,704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3月24日 至 2024年3月18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>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2024年3月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

（デリバティブ取引に関する注記）

（2024年3月18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	59,319,600	-	59,718,720	399,120
	小計	59,319,600	-	59,718,720	399,120
合計		59,319,600	-	59,718,720	399,120

（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3月24日

至 2024年3月18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3月18日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	3,732,230,707円
同期中における追加設定元本額	4,149,689,752円
同期中における一部解約元本額	388,367,083円
2024年3月18日現在の元本の内訳	
日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)	325,276,766円
日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)	6,142,418,769円
三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド	52,754,025円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	148,521,998円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	369,923,548円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	238,070,353円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	51,698,314円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	5,365,875円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	5,874,958円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	3,599,114円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	5,051,036円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	1,679,040円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	973,548円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	212,232円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	8,898,036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)	61,456,512円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	49,351,400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)	22,427,852円
合計	7,493,553,376円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	ADGB 1.875 09/15/31	1,700,000.00	1,403,214.00	
		ADGB 2.5 04/16/25	700,000.00	679,714.00	
		ADGB 2.5 09/30/29	200,000.00	178,952.00	
		ADGB 3.125 04/16/30	600,000.00	549,786.00	
		ADGB 3.125 09/30/49	1,300,000.00	907,088.00	
		ADGB 3.875 04/16/50	200,000.00	159,066.00	
		BRAZIL 2.875 06/06/25	600,000.00	579,060.00	
		BRAZIL 3.75 09/12/31	600,000.00	521,478.00	
		BRAZIL 3.875 06/12/30	500,000.00	450,620.00	

BRAZIL 4.75 01/14/50	700,000.00	514,612.00	
BRAZIL 5.625 01/07/41	200,000.00	178,350.00	
BRAZIL 6 10/20/33	1,400,000.00	1,380,498.00	
BRAZIL 6.25 03/18/31	300,000.00	305,112.00	
BRAZIL 7.125 05/13/54	300,000.00	297,870.00	
CHILE 2.55 07/27/33	800,000.00	646,368.00	
CHILE 2.75 01/31/27	400,000.00	374,384.00	
CHILE 3.1 05/07/41	200,000.00	146,124.00	
CHILE 3.5 01/25/50	600,000.00	433,374.00	
CHILE 3.5 01/31/34	500,000.00	433,680.00	
CHILE 4.34 03/07/42	600,000.00	518,028.00	
CHILE 4.85 01/22/29	400,000.00	395,960.00	
CHILE 4.95 01/05/36	600,000.00	578,172.00	
CHINA (PEOPLE'S) 1.2 10/21/30	700,000.00	577,710.00	
CHINA (PEOPLE'S) 2.125 12/03/29	300,000.00	267,816.00	
CHINA 0.55 10/21/25	200,000.00	186,546.00	
CHINA 1.25 10/26/26	700,000.00	641,627.00	
COLOM 3.125 04/15/31	800,000.00	637,008.00	
COLOM 7.5 02/02/34	1,400,000.00	1,419,530.00	
COLOM 8 04/20/33	800,000.00	839,640.00	
DOMREP 5.5 02/22/29	500,000.00	485,525.00	
DOMREP 5.875 01/30/60	1,100,000.00	932,657.00	
DOMREP 6 02/22/33	1,700,000.00	1,654,100.00	
INDON 3.05 03/12/51	200,000.00	140,352.00	
INDON 3.85 10/15/30	400,000.00	371,620.00	
INDON 4.2 10/15/50	200,000.00	166,750.00	
INDON 4.75 01/08/26	400,000.00	398,688.00	
INDON 5.125 01/15/45	400,000.00	392,248.00	
KSA 2.25 02/02/33	1,600,000.00	1,278,736.00	
KSA 3.625 03/04/28	600,000.00	573,342.00	
KSA 4.75 01/18/28	600,000.00	597,822.00	
KSA 4.875 07/18/33	700,000.00	690,669.00	
KSA 5 01/16/34	700,000.00	691,824.00	
KSA 5 01/18/53	800,000.00	708,448.00	
KSA 5.25 01/16/50	600,000.00	558,132.00	
KSA 5.75 01/16/54	200,000.00	195,496.00	
MEX 2.659 05/24/31	1,200,000.00	993,660.00	
MEX 3.25 04/16/30	200,000.00	176,898.00	
MEX 4.5 01/31/50	300,000.00	232,782.00	
MEX 4.5 04/22/29	200,000.00	192,546.00	
MEX 4.875 05/19/33	1,000,000.00	939,440.00	
MEX 5 04/27/51	900,000.00	746,145.00	

MEX 6 05/07/36	300,000.00	298,461.00	
MEX 6.338 05/04/53	900,000.00	877,563.00	
MEX 6.35 02/09/35	500,000.00	511,140.00	
MEX 6.4 05/07/54	200,000.00	197,088.00	
OMAN 6 08/01/29	600,000.00	611,286.00	
OMAN 6.25 01/25/31	1,200,000.00	1,237,392.00	
PANAMA 2.252 09/29/32	800,000.00	574,320.00	
PANAMA 4.5 01/19/63	800,000.00	514,464.00	
PANAMA 6.4 02/14/35	900,000.00	853,776.00	
PERU 2.783 01/23/31	1,000,000.00	849,950.00	
PERU 3 01/15/34	200,000.00	162,440.00	
PERU 5.625 11/18/50	800,000.00	789,240.00	
PHILIP 1.648 06/10/31	200,000.00	158,874.00	
PHILIP 2.65 12/10/45	400,000.00	260,544.00	
PHILIP 2.95 05/05/45	200,000.00	138,750.00	
PHILIP 3.7 02/02/42	200,000.00	161,512.00	
QATAR 3.4 04/16/25	400,000.00	392,700.00	
QATAR 3.75 04/16/30	1,600,000.00	1,527,296.00	
QATAR 4.4 04/16/50	1,900,000.00	1,666,433.00	
REPHUN 5.25 06/16/29	500,000.00	493,085.00	
REPHUN 5.5 03/26/36	1,100,000.00	1,058,497.00	
REPHUN 6.25 09/22/32	900,000.00	932,616.00	
SOAF 4.85 09/30/29	800,000.00	720,760.00	
SOAF 7.3 04/20/52	1,100,000.00	955,878.00	
TURKEY 6.125 10/24/28	800,000.00	772,000.00	
TURKEY 6.375 10/14/25	400,000.00	400,128.00	
TURKEY 7.625 05/15/34	300,000.00	294,888.00	
TURKEY 9.125 07/13/30	1,100,000.00	1,174,316.00	
TURKEY 9.375 01/19/33	1,400,000.00	1,534,204.00	
TURKEY 9.875 01/15/28	1,400,000.00	1,525,720.00	
URUGUA 4.375 01/23/31	400,000.00	391,028.00	
URUGUA 4.975 04/20/55	400,000.00	373,284.00	
URUGUA 5.75 10/28/34	300,000.00	316,038.00	
アメリカ・ドル小計	56,800,000.00	52,044,938.00 (7,771,350,142)	
国債証券合計		7,771,350,142 (7,771,350,142)	
合 計		7,771,350,142 (7,771,350,142)	

(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 84銘柄	96.9%	100.0%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

Jリート・インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

		(2024年3月18日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託		4,985,465
コール・ローン		185,999,973
投資証券		14,172,858,300
派生商品評価勘定		345,600
未収配当金		193,933,367
差入委託証拠金		2,072,652
流動資産合計		14,560,195,357
資産合計		14,560,195,357
負債の部		
流動負債		
前受金		410,000
未払金		147,274,820
未払解約金		5,000
その他未払費用		131
流動負債合計		147,689,951
負債合計		147,689,951
純資産の部		
元本等		
元本		5,754,272,779
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		8,658,232,627
元本等合計		14,412,505,406
純資産合計		14,412,505,406
負債純資産合計		14,560,195,357

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年3月24日 至 2024年3月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	(2024年3月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	5,754,272,779口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.5047円 (1万口当たりの純資産額25,047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3月24日 至 2024年3月18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、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2024年3月18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3月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	リート指数先物取引 買建				
	TREIT先物0606月	33,824,400	-	34,170,000	345,600
	小計	33,824,400	-	34,170,000	345,600
合計		33,824,400	-	34,170,000	345,600

(注)1.時価の算定方法

リート指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2)リート指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2023年3月24日
至 2024年3月18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3月18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	4,375,703,265円
同期中における追加設定元本額	3,038,496,908円
同期中における一部解約元本額	1,659,927,394円
2024年3月18日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	223,670,880円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	359,312,135円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	188,982,889円
イオン・バランス戦略ファンド	24,425,293円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	2,700,038,230円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	27,468,328円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	44,853,288円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	51,353,884円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	214,273,450円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	137,432,696円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	106,355,358円

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	52,646,694円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,874,604円
三井住友DS・国内リートインデックス年金ファンド	342,579,794円
日興FWS・Jリートインデックス	895,485,274円
三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド	79,096,288円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	2,107,693円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	1,408,169円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	2,442,794円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	899,547円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	521,810円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	289,016円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	9,178,425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)	57,487,834円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	44,153,004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)	19,202,498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>	2,657,047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>	69,181,938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>	36,290,409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>	57,603,510円
合計	5,754,272,779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	288	33,609,600	
	サンケイリアルエステート投資法人	455	38,993,500	
	SOSILA物流リート投資法人	720	83,448,000	
	東海道リート投資法人	244	29,938,800	
	日本アコモデーションファンド投資法人	498	297,804,000	
	森ヒルズリート投資法人	1,697	228,076,800	
	産業ファンド投資法人	2,625	345,450,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	1,412	449,016,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	755	286,145,000	
	GLP投資法人	4,866	593,652,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	709	214,827,000	
	日本プロロジスリート投資法人	2,507	635,524,500	
	星野リゾート・リート投資法人	265	148,400,000	
	Oneリート投資法人	250	62,575,000	
イオンリート投資法人	1,770	237,888,000		

ヒューリックリート投資法人	1,349	195,470,100	
日本リート投資法人	467	156,445,000	
積水ハウス・リート投資法人	4,331	331,754,600	
トーセイ・リート投資法人	298	41,004,800	
ヘルスケア&メディカル投資法人	351	45,559,800	
サムティ・レジデンシャル投資法人	391	40,351,200	
野村不動産マスターファンド投資法人	4,656	652,305,600	
いちごホテルリート投資法人	233	25,233,900	
ラサールロジポート投資法人	1,842	278,142,000	
スターアジア不動産投資法人	2,225	122,597,500	
マリモ地方創生リート投資法人	217	25,801,300	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	598	263,120,000	
日本ホテル&レジデンシャル投資法人	212	16,875,200	
投資法人みらい	1,988	87,472,000	
三菱地所物流リート投資法人	496	182,280,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	623	90,958,000	
ザイマックス・リート投資法人	229	26,083,100	
タカラレーベン不動産投資法人	762	74,523,600	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	636	75,238,800	
日本ビルファンド投資法人	1,679	975,499,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	1,479	792,744,000	
日本都市ファンド投資法人	6,905	622,140,500	
オリックス不動産投資法人	2,871	449,598,600	
日本プライムリアルティ投資法人	985	311,260,000	
N T T 都市開発リート投資法人	1,465	171,698,000	
東急リアル・エステート投資法人	966	155,526,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	1,067	116,089,600	
ユナイテッド・アーバン投資法人	3,224	467,480,000	
森トラストリート投資法人	2,783	194,253,400	
インヴィンシブル投資法人	6,977	459,784,300	
フロンティア不動産投資法人	534	232,557,000	
平和不動産リート投資法人	1,079	144,693,900	
日本ロジスティクスファンド投資法人	921	247,104,300	
福岡リート投資法人	747	125,944,200	
K D X 不動産投資法人	4,141	609,969,300	
いちごオフィスリート投資法人	1,187	93,416,900	
大和証券オフィス投資法人	294	166,992,000	
阪急阪神リート投資法人	691	94,045,100	
スターツプロシード投資法人	247	48,486,100	
大和ハウスリート投資法人	2,171	537,322,500	

ジャパン・ホテル・リート投資法人	4,826	373,049,800	
大和証券リビング投資法人	2,063	212,901,600	
ジャパンエクセレント投資法人	1,255	153,737,500	
投資証券 小計		14,172,858,300	
合計		14,172,858,300	

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3月18日現在)

資産の部		
流動資産		
預金		1,232,613,322
金銭信託		7,985,937
コール・ローン		297,942,959
投資証券		33,651,207,261
派生商品評価勘定		1,439,281
未収入金		9,901,640
未収配当金		134,392,779
流動資産合計		35,335,483,179
資産合計		35,335,483,179
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		39,537
未払金		932,553,918
未払解約金		8,468,069
その他未払費用		46
流動負債合計		941,061,570
負債合計		941,061,570
純資産の部		
元本等		
元本		10,694,933,338
剰余金		
剰余金又は欠損金()		23,699,488,271
元本等合計		34,394,421,609
純資産合計		34,394,421,609
負債純資産合計		35,335,483,179

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2023年3月24日 至 2024年3月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	(2024年3月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	10,694,933,338口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.2160円 (1万口当たりの純資産額32,160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3月24日 至 2024年3月18日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、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>
<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3月18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ぬ。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券（投資証券）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(2024年3月18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	214,100,000	-	215,258,394	1,158,394
	カナダ・ドル	4,000,000	-	4,000,104	104
	オーストラリア・ド ル	21,400,000	-	21,479,921	79,921
	香港・ドル	10,000,000	-	10,037,923	37,923
	シンガポール・ドル	13,300,000	-	13,333,712	33,712
	ニュージーランド・ ドル	10,800,000	-	10,799,880	120
	イギリス・ポンド	14,000,000	-	14,068,402	68,402
	ユーロ	14,200,000	-	14,260,577	60,577
	小計	301,800,000	-	303,238,913	1,438,913
	売建				
	オーストラリア・ド ル	1,000,000	-	1,000,020	20
	シンガポール・ドル	5,700,000	-	5,738,862	38,862
	イギリス・ポンド	500,000	-	500,008	8
	イスラエル・シュケ ル	100,000	-	100,279	279
	小計	7,300,000	-	7,339,169	39,169
合 計		309,100,000	-	310,578,082	1,399,744

(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3月24日 至 2024年3月18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3月18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	9,550,824,997円
同期中における追加設定元本額	2,545,785,392円
同期中における一部解約元本額	1,401,677,051円
2024年3月18日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	19,062,981円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	27,082,042円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	39,629,837円
イオン・バランス戦略ファンド	37,142,916円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	8,448,364,350円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	9,910,853円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	35,891,483円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	38,588,464円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	164,364,963円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	104,592,996円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	81,569,226円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	122,850,318円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	1,013,340円
三井住友D S・外国リートインデックス年金ファンド	375,715,415円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	67,082,061円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	918,384,291円
三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド	121,316,673円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	1,296,045円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	690,096円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	973,336円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	316,204円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	182,973円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	30,988円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	538,158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)	3,352,612円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	2,349,121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)	994,144円

S M A M ・ 世界リート・インデックスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	29,202,471円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	42,444,981円
合 計	10,694,933,338円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	14,653.00	236,939.01	
		AGREE REALTY CORP	16,311.00	923,691.93	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	12,195.00	194,632.20	
		ALEXANDER'S INC	300.00	61,569.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	26,729.00	3,307,713.75	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	2,165.00	33,146.15	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	10,429.00	220,781.93	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	53,816.00	1,952,444.48	
		AMERICOLD REALTY TRUST INC	43,507.00	1,098,551.75	
		APARTMENT INCOME REIT CO	23,374.00	740,722.06	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	23,200.00	172,608.00	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	37,103.00	600,326.54	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	15,799.00	164,783.57	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	2,515.00	3,470.70	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	24,324.00	4,471,237.68	
		BOSTON PROPERTIES INC	25,222.00	1,578,897.20	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	8,400.00	15,540.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	34,607.00	151,232.59	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	49,398.00	1,094,165.70	
		BROADSTONE NET LEASE INC	31,774.00	473,432.60	
		BRT APARTMENTS CORP	500.00	8,190.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	18,587.00	1,830,633.63	
		CARETRUST REIT INC	24,090.00	565,633.20	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	3,648.00	80,256.00	
		CENTERSPACE	2,600.00	145,938.00	
		CHATHAM LODGING TRUST	12,827.00	128,783.08	
		CITY OFFICE REIT INC	4,603.00	19,332.60	
		CLIPPER REALTY INC	800.00	3,928.00	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3,216.00	85,416.96	
		COPT DEFENSE PROPERTIES	20,034.00	484,221.78	
		COUSINS PROPERTIES INC	25,172.00	584,745.56	
		CTO REALTY GROWTH INC	3,839.00	64,034.52	
		CUBESMART	38,168.00	1,632,827.04	
DIAMONDRock HOSPITALITY CO	33,165.00	311,087.70			

DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	69,000.00	38,985.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	51,541.00	7,260,065.26	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	23,884.00	58,515.80	
DOUGLAS EMMETT INC	26,346.00	346,186.44	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	20,000.00	2,740.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	15,924.00	181,852.08	
EASTGROUP PROPERTIES INC	8,350.00	1,471,520.50	
ELME COMMUNITIES	15,190.00	202,938.40	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	21,276.00	208,292.04	
EPR PROPERTIES	12,612.00	521,506.20	
EQUINIX INC	15,989.00	13,596,885.71	
EQUITY COMMONWEALTH	17,598.00	332,778.18	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	31,447.00	2,057,577.21	
EQUITY RESIDENTIAL	59,312.00	3,738,435.36	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	26,412.00	669,808.32	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,087.00	2,650,569.09	
EXTRA SPACE STORAGE INC	35,863.00	4,996,791.79	
FARMLAND PARTNERS INC	7,194.00	77,695.20	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	12,031.00	1,192,512.72	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	21,613.00	1,127,766.34	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	13,780.00	338,299.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	15,115.00	32,799.55	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	46,310.00	2,090,433.40	
GETTY REALTY CORP	6,971.00	189,262.65	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5,368.00	70,267.12	
GLADSTONE LAND CORP	4,464.00	58,032.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	12,642.00	110,491.08	
GLOBAL NET LEASE INC	30,518.00	230,410.90	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	61,807.00	813,380.12	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	118,217.00	2,038,061.08	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	16,359.00	399,813.96	
HOST HOTELS & RESORTS INC	118,744.00	2,435,439.44	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	17,289.00	110,303.82	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	36,893.00	574,424.01	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	6,274.00	24,343.12	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	4,322.00	417,807.74	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	11,866.00	293,802.16	
INVITATION HOMES INC	98,945.00	3,459,117.20	
IRON MOUNTAIN INC	48,990.00	3,851,103.90	
JBG SMITH PROPERTIES	14,792.00	246,138.88	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	130,900.00	16,493.40	
KILROY REALTY CORP	19,409.00	672,910.03	
KIMCO REALTY CORP	112,087.00	2,116,202.56	
KITE REALTY GROUP TRUST	38,279.00	795,054.83	

LTC PROPERTIES INC	7,251.00	233,409.69	
LXP INDUSTRIAL TRUST	52,073.00	467,615.54	
MACERICH CO/THE	38,484.00	620,746.92	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	245,900.00	14,754.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	97,588.00	429,387.20	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	19,910.00	2,595,069.40	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	13,122.00	474,885.18	
NATL HEALTH INVESTORS INC	7,193.00	432,299.30	
NET LEASE OFFICE PROPERTY	2,275.00	52,325.00	
NETSTREIT CORP	13,768.00	235,432.80	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	7,663.00	46,820.93	
NEXPOINT RESIDENTIAL	3,529.00	105,693.55	
NNN REIT INC	32,073.00	1,329,746.58	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	9,538.00	19,362.14	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	41,958.00	1,290,628.08	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,352.00	53,084.64	
ORION OFFICE REIT INC	8,094.00	28,167.12	
PARAMOUNT GROUP INC	23,577.00	108,689.97	
PARK HOTELS & RESORTS INC	35,722.00	611,203.42	
PEAKSTONE REALTY TRUST	7,728.00	116,383.68	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	20,329.00	315,099.50	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	19,743.00	695,940.75	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	19,902.00	125,780.64	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,774.00	102,641.00	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	1,424.00	19,936.00	
PRIME US REIT	143,770.00	18,977.64	
PROLOGIS INC	157,181.00	20,279,492.62	
PUBLIC STORAGE	26,826.00	7,431,875.04	
REALTY INCOME CORP	141,961.00	7,408,944.59	
REGENCY CENTERS CORP	28,641.00	1,692,110.28	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	22,092.00	277,475.52	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	35,704.00	1,835,542.64	
RLJ LODGING TRUST	24,132.00	283,792.32	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	10,529.00	1,212,940.80	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	37,565.00	530,793.45	
SAFEHOLD INC	5,574.00	109,696.32	
SAUL CENTERS INC	2,331.00	85,827.42	
SERVICE PROPERTIES TRUST	25,446.00	165,653.46	
SIMON PROPERTY GROUP INC	55,624.00	8,386,430.48	
SITE CENTERS CORP	32,493.00	458,151.30	
SL GREEN REALTY CORP	11,643.00	588,204.36	
STAG INDUSTRIAL INC	32,025.00	1,191,650.25	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	14,098.00	87,407.60	
SUN COMMUNITIES INC	20,902.00	2,737,952.98	

	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	32,379.00	356,169.00	
	TANGER INC	17,266.00	488,973.12	
	TERRENO REALTY CORP	15,648.00	982,537.92	
	UDR INC	51,176.00	1,902,211.92	
	UMH PROPERTIES INC	11,316.00	176,755.92	
	UNITI GROUP INC	46,029.00	286,300.38	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,344.00	47,496.96	
	URBAN EDGE PROPERTIES	20,402.00	336,020.94	
	VENTAS INC	69,357.00	2,946,285.36	
	VERIS RESIDENTIAL INC	10,798.00	160,026.36	
	VICI PROPERTIES INC	176,264.00	5,099,317.52	
	VORNADO REALTY TRUST	25,943.00	660,768.21	
	WELLTOWER INC	94,442.00	8,627,276.70	
	WHITESTONE REIT	4,511.00	53,816.23	
	WP CAREY INC	36,813.00	2,061,159.87	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	17,827.00	263,126.52	
	アメリカ・ドル小計	4,336,102.00	175,314,993.53 (26,178,034,834)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	8,800.00	150,304.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	9,662.00	59,324.68	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,675.00	284,665.50	
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	3,187.00	49,366.63	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	6,841.00	20,933.46	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,077.00	676,540.62	
	CHOICE PROPERTIES REIT	30,541.00	413,830.55	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	10,639.00	147,562.93	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	9,193.00	127,782.70	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	23,474.00	299,058.76	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2,732.00	44,012.52	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	21,618.00	332,268.66	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	5,260.00	384,400.80	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	21,001.00	182,708.70	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11,198.00	157,891.80	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	8,107.00	152,411.60	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,447.00	23,875.50	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1,557.00	24,927.57	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	4,345.00	33,022.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	20,754.00	94,845.78	
	PRIMARIS REIT	6,318.00	83,966.22	
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	15,604.00	83,169.32	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	24,676.00	439,232.80	
	SLATE GROCERY REIT-CL U	3,196.00	35,699.32	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	12,000.00	270,600.00		
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	829.00	7,552.19		

	カナダ・ドル小計	280,731.00	4,579,954.61 (504,939,996)	
オーストラ リア・ドル	ABACUS GROUP	50,980.00	63,979.90	
	ABACUS STORAGE KING	145,482.00	178,215.45	
	ARENA REIT	45,981.00	165,071.79	
	BWP TRUST	66,965.00	241,743.65	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	104,758.00	187,516.82	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	84,443.00	301,461.51	
	CENTURIA OFFICE REIT	68,559.00	84,327.57	
	CHARTER HALL GROUP	83,440.00	1,123,102.40	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	97,225.00	365,566.00	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	91,686.00	328,235.88	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	72,491.00	193,550.97	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	218,718.00	95,142.33	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	30,237.00	92,827.59	
	DEXUS/AU	180,582.00	1,367,005.74	
	GDI PROPERTY GROUP	83,204.00	50,338.42	
	GOODMAN GROUP	294,590.00	9,091,047.40	
	GPT GROUP	330,937.00	1,459,432.17	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	52,361.00	128,284.45	
	HEALTHCO REIT	51,410.00	72,745.15	
	HMC CAPITAL LTD	33,678.00	245,512.62	
	HOMEKO DAILY NEEDS REIT	332,002.00	436,582.63	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	25,921.00	82,169.57	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	62,840.00	318,598.80	
	MIRVAC GROUP	701,595.00	1,522,461.15	
	NATIONAL STORAGE REIT	208,817.00	501,160.80	
	REGION RE LTD	191,819.00	427,756.37	
	RURAL FUNDS GROUP	52,739.00	111,806.68	
SCENTRE GROUP	901,932.00	3,012,452.88		
STOCKLAND	416,620.00	2,020,607.00		
VICINITY CENTRES	664,812.00	1,396,105.20		
WAYPOINT REIT	113,111.00	277,121.95		
	オーストラリア・ドル小計	5,859,935.00	25,941,930.84 (2,541,012,126)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	277,000.00	440,430.00	
	FORTUNE REIT	259,000.00	1,113,700.00	
	LINK REIT	436,700.00	15,961,385.00	
	PROSPERITY REIT	178,000.00	218,940.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	202,000.00	337,340.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	494,000.00	513,760.00	
	香港・ドル小計	1,846,700.00	18,585,555.00 (354,798,245)	
	AIMS APAC REIT	113,300.00	141,625.00	

シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	610,200.00	1,623,132.00	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	428,155.00	387,480.27	
	CAPITALAND CHINA TRUST	205,700.00	150,161.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	881,308.00	1,692,111.36	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	159,550.00	157,954.50	
	EC WORLD REIT	52,800.00	14,784.00	
	ESR-LOGOS REIT	1,097,413.00	323,736.83	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	190,000.00	114,950.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	221,100.00	481,998.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC I	527,638.00	538,190.76	
	KEPPEL DC REIT	200,100.00	336,168.00	
	KEPPEL REIT	363,300.00	310,621.50	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	262,000.00	146,720.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	324,500.00	736,615.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	558,250.00	803,880.00	
	MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	355,000.00	454,400.00	
	PARAGON REIT	215,200.00	176,464.00	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	69,800.00	239,414.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	66,700.00	46,023.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	195,000.00	93,600.00	
SUNTEC REIT	416,400.00	445,548.00		
シンガポール・ドル小計		7,513,414.00	9,415,577.22	(1,050,307,639)
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	153,482.00	172,667.25	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	211,264.00	481,681.92	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	264,918.00	219,881.94	
	PRECINCT PROPERTIES GROUP	217,149.00	255,150.07	
ニュージーランド・ドル小計		846,813.00	1,129,381.18	(102,649,454)
イギリス・ポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	53,280.00	28,451.52	
	AEW UK REIT PLC	9,000.00	8,100.00	
	ASSURA PLC	472,915.00	196,259.72	
	BALANCED COMM PROPERTY TRUST	154,750.00	120,086.00	
	BIG YELLOW GROUP PLC	35,499.00	369,189.60	
	BRITISH LAND CO PLC	150,571.00	554,402.42	
	CLS HOLDINGS PLC	41,598.00	37,937.37	
	CUSTODIAN PROPERTY INCOME RE	84,958.00	60,490.09	
	DERWENT LONDON PLC	20,725.00	428,593.00	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	95,000.00	90,250.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	41,616.00	157,974.33	
	HAMMERSON PLC	591,835.00	158,019.94	
	HELICAL PLC	17,000.00	35,105.00	
	HOME REIT PLC	96,051.00	36,499.38	
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	88,651.00	72,605.16		

	LAND SECURITIES GROUP PLC	127,936.00	789,109.24	
	LIFE SCIENCE REIT PLC	104,502.00	43,472.83	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	343,240.00	654,558.68	
	NEWRIVER REIT PLC	46,021.00	34,469.72	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	57,141.00	35,941.68	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	212,067.00	192,768.90	
	PRS REIT PLC/THE	89,207.00	67,262.07	
	REGIONAL REIT LTD	159,212.00	25,473.92	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	41,662.00	308,298.80	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	70,698.00	29,198.27	
	SEGRE PLC	231,203.00	1,961,063.84	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	304,853.00	402,710.81	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	187,422.00	140,753.92	
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	113,949.00	89,677.86	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	34,770.00	20,514.30	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	322,665.00	478,189.53	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	117,847.00	75,304.23	
	UNITE GROUP PLC/THE	68,968.00	651,402.76	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	76,400.00	90,152.00	
	WAREHOUSE REIT PLC	72,100.00	55,661.20	
	WORKSPACE GROUP PLC	20,210.00	100,241.60	
	イギリス・ポンド小計	4,755,522.00	8,600,189.69 (1,635,154,066)	
イスラエル・シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	110,000.00	186,340.00	
	REIT 1 LTD	29,102.00	462,721.80	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	36,242.00	273,772.06	
	イスラエル・シュケル小計	175,344.00	922,833.86 (37,520,395)	
韓国・ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	6,350.00	22,574,250.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	24,000.00	99,720,000.00	
	JR REIT XXVII	36,632.00	151,473,320.00	
	KORAMCO LIFE INFRA REIT	6,226.00	31,192,260.00	
	LOTTE REIT CO LTD	20,121.00	67,405,350.00	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	12,561.00	44,905,575.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	8,762.00	61,596,860.00	
	SK REITS CO LTD	12,831.00	52,222,170.00	
	韓国・ウォン小計	127,483.00	531,089,785.00 (59,641,383)	
ユーロ	AEDIFICA	8,492.00	441,584.00	
	ALTAREA	723.00	50,537.70	
	CARE PROPERTY INVEST	5,582.00	70,779.76	
	CARMILA	10,208.00	165,165.44	
	COFINIMMO	6,947.00	399,452.50	
	COVIVIO	8,887.00	376,453.32	
	CROMWELL REIT EUR	48,320.00	63,299.20	

	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	6,975.00	137,407.50	
	GECINA SA	8,447.00	767,832.30	
	HAMBORNER REIT AG	12,058.00	79,703.38	
	ICADE	4,873.00	121,825.00	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	7,889.00	11,486.38	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	44,900.00	230,112.50	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	62,588.00	62,838.35	
	KLEPIERRE	31,494.00	744,518.16	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	6,940.00	46,498.00	
	MERCIALYS	15,342.00	157,255.50	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	57,481.00	524,226.72	
	MONTEA NV	2,735.00	212,236.00	
	NSI NV	2,966.00	57,421.76	
	RETAIL ESTATES	2,065.00	127,617.00	
	SHURGARD SELF STORAGE LTD	5,082.00	203,788.20	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	17,823.00	1,247,253.54	
	VASTNED RETAIL NV	2,919.00	62,758.50	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	28,540.00	700,371.60	
	WERELDHAVE NV	6,708.00	91,027.56	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	5,846.00	148,488.40	
	ユーロ小計	422,830.00	7,301,938.27 (1,187,149,124)	
	投資証券合計		33,651,207,261 (33,651,207,261)	
	合計		33,651,207,261 (33,651,207,261)	

(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 138銘柄	76.1%	77.8%
カナダ・ドル	投資証券 26銘柄	1.5%	1.5%
オーストラリア・ドル	投資証券 31銘柄	7.4%	7.6%
香港・ドル	投資証券 6銘柄	1.0%	1.1%
シンガポール・ドル	投資証券 22銘柄	3.1%	3.1%
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 36銘柄	4.8%	4.9%
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 8銘柄	0.2%	0.2%
ユーロ	投資証券 27銘柄	3.5%	3.5%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

ゴールド・インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

(2024年3月18日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	110,683,076
金銭信託	2,104,502
コール・ローン	78,515,728
投資信託受益証券	9,630,891,487
派生商品評価勘定	37
流動資産合計	9,822,194,830
資産合計	9,822,194,830
負債の部	
流動負債	
未払金	58,958,106
未払解約金	3,188,440
その他未払費用	89
流動負債合計	62,146,635
負債合計	62,146,635
純資産の部	
元本等	
元本	6,243,929,441
剰余金	
剰余金又は欠損金 ()	3,516,118,754
元本等合計	9,760,048,195
純資産合計	9,760,048,195
負債純資産合計	9,822,194,830

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2023年3月24日 至 2024年3月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	(2024年3月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	6,243,929,441口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.5631円 (1万口当たりの純資産額15,631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3月24日 至 2024年3月18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、投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、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3月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(投資信託受益証券) 「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3月18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	10,898,629	-	10,898,666	37
	小計	10,898,629	-	10,898,666	37
合 計		10,898,629	-	10,898,666	37

(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3月24日 至 2024年3月18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3月18日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	3,822,730,291円
同期中における追加設定元本額	3,086,968,384円
同期中における一部解約元本額	665,769,234円
2024年3月18日現在の元本の内訳	
日興FWS・ゴールド(為替ヘッジあり)	227,679,857円
日興FWS・ゴールド(為替ヘッジなし)	5,238,776,443円
三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)	655,757,225円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	361,870円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	10,623,315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)	57,304,223円

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	38,284,575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)	15,141,933円
合計	6,243,929,441円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	ISHARES GOLD TRUST	634,440.00	25,885,152.00	
		SPDR GOLD MINISHARES TRUST	902,810.00	38,613,183.70	
	アメリカ・ドル小計		1,537,250.00	64,498,335.70	(9,630,891,487)
投資信託受益証券合計				9,630,891,487	(9,630,891,487)
合計				9,630,891,487	(9,630,891,487)

(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	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 2銘柄	98.7%	100.0%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

【中間財務諸表】

1. 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3、第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期中間計算期間(2024年3月19日から2024年9月18日まで)の中間財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人により中間監査を受けております。

【三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (2024年 3月18日現在)	第2期中間計算期間 (2024年 9月18日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	9,807	2,394
コール・ローン	365,866	352,936
親投資信託受益証券	24,189,965	44,367,806
派生商品評価勘定	-	13,843
未収入金	6,608	22,829
流動資産合計	24,572,246	44,759,808
資産合計	24,572,246	44,759,808
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	13,648	-
未払受託者報酬	3,092	5,461
未払委託者報酬	151,073	265,752
その他未払費用	392	739
流動負債合計	168,205	271,952
負債合計	168,205	271,952
純資産の部		
元本等		
元本	23,434,308	42,604,774
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	969,733	1,883,082
(分配準備積立金)	448,497	448,497
元本等合計	24,404,041	44,487,856
純資産合計	24,404,041	44,487,856
負債純資産合計	24,572,246	44,759,808

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第1期中間計算期間 自 2023年 3月24日 至 2023年 9月23日	第2期中間計算期間 自 2024年 3月19日 至 2024年 9月18日
営業収益		
受取利息	-	64
有価証券売買等損益	3,857	327,841
為替差損益	22,396	27,862
営業収益合計	26,253	355,767
営業費用		
受託者報酬	642	5,461
委託者報酬	33,230	265,752
その他費用	7,746	739
営業費用合計	41,618	271,952
営業利益又は営業損失（ ）	67,871	83,815
経常利益又は経常損失（ ）	67,871	83,815
中間純利益又は中間純損失（ ）	67,871	83,815
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	-	-
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	969,733
剰余金増加額又は欠損金減少額	206,457	829,534
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	206,457	829,534
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	138,586	1,883,082

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第2期中間計算期間 自 2024年3月19日 至 2024年9月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 (2024年3月18日現在)	第2期中間計算期間 (2024年9月18日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	23,434,308口	42,604,774口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0414円 (1万口当たりの純資産額10,414円)	1口当たり純資産額 1.0442円 (1万口当たりの純資産額10,442円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期中間計算期間 (2024年9月18日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>

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

(デリバティブ取引に関する注記)

第1期(2024年3月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	824,089	-	837,737	13,648
	小計	824,089	-	837,737	13,648
合計		824,089	-	837,737	13,648

第2期中間計算期間(2024年9月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	1,151,139	-	1,137,296	13,843
	小計	1,151,139	-	1,137,296	13,843
合計		1,151,139	-	1,137,296	13,843

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

項目	第1期 (2024年3月18日現在)	第2期中間計算期間 (2024年9月18日現在)
期首元本額	1,000,000円	23,434,308円
期中追加設定元本額	27,380,396円	19,170,466円
期中一部解約元本額	4,946,088円	-円

【三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (2024年 3月18日現在)	第2期中間計算期間 (2024年 9月18日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	76,774	31,667
コール・ローン	2,864,331	4,667,500
親投資信託受益証券	257,524,737	611,007,548
派生商品評価勘定	-	663,598
未収入金	110,020	1,281,599
流動資産合計	260,575,862	617,651,912
資産合計	260,575,862	617,651,912
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	468,881	14,280
未払受託者報酬	32,298	72,325
未払委託者報酬	1,670,972	3,738,860
その他未払費用	5,315	10,777
流動負債合計	2,177,466	3,836,242
負債合計	2,177,466	3,836,242
純資産の部		
元本等		
元本	237,262,587	558,911,638
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	21,135,809	54,904,032
(分配準備積立金)	9,967,661	9,860,520
元本等合計	258,398,396	613,815,670
純資産合計	258,398,396	613,815,670
負債純資産合計	260,575,862	617,651,912

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第1期中間計算期間 自 2023年 3月24日 至 2023年 9月23日	第2期中間計算期間 自 2024年 3月19日 至 2024年 9月18日
営業収益		
受取利息	-	2,362
有価証券売買等損益	99,773	1,352,811
為替差損益	257,293	2,812,928
営業収益合計	357,066	4,168,101
営業費用		
支払利息	1	-
受託者報酬	3,967	72,325
委託者報酬	206,425	3,738,860
その他費用	8,239	10,777
営業費用合計	218,632	3,821,962
営業利益又は営業損失（ ）	575,698	346,139
経常利益又は経常損失（ ）	575,698	346,139
中間純利益又は中間純損失（ ）	575,698	346,139
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	7,330	570
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	21,135,809
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,374,496	33,738,380
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,374,496	33,738,380
剰余金減少額又は欠損金増加額	117,962	316,866
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	117,962	316,866
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,673,506	54,904,032

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第2期中間計算期間 自 2024年3月19日 至 2024年9月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 (2024年3月18日現在)	第2期中間計算期間 (2024年9月18日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	237,262,587口	558,911,638口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0891円 (1万口当たりの純資産額10,891円)	1口当たり純資産額 1.0982円 (1万口当たりの純資産額10,982円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期中間計算期間 (2024年9月18日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>

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

(デリバティブ取引に関する注記)

第1期（2024年3月18日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	27,213,158	-	27,682,039	468,881
	小計	27,213,158	-	27,682,039	468,881
合計		27,213,158	-	27,682,039	468,881

第2期中間計算期間（2024年9月18日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	58,317,648	-	57,668,330	649,318
	小計	58,317,648	-	57,668,330	649,318
合計		58,317,648	-	57,668,330	649,318

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

項目	第1期 (2024年3月18日現在)	第2期中間計算期間 (2024年9月18日現在)
期首元本額	1,000,000円	237,262,587円
期中追加設定元本額	239,675,062円	325,141,629円
期中一部解約元本額	3,412,475円	3,492,578円

【三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル3（安定成長型）】

（ 1 ）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 （2024年 3月18日現在）	第2期中間計算期間 （2024年 9月18日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	224,319	117,579
コール・ローン	8,369,005	17,330,427
親投資信託受益証券	1,121,914,475	2,281,369,961
派生商品評価勘定	-	3,564,746
未収入金	796,745	6,686,807
流動資産合計	1,131,304,544	2,309,069,520
資産合計	1,131,304,544	2,309,069,520
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,758,846	60,214
未払金	-	14,884
未払受託者報酬	120,749	278,055
未払委託者報酬	6,442,177	14,831,771
その他未払費用	20,435	41,624
流動負債合計	9,342,207	15,226,548
負債合計	9,342,207	15,226,548
純資産の部		
元本等		
元本	1,000,497,782	2,023,249,551
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	121,464,555	270,593,421
（分配準備積立金）	46,586,791	45,993,016
元本等合計	1,121,962,337	2,293,842,972
純資産合計	1,121,962,337	2,293,842,972
負債純資産合計	1,131,304,544	2,309,069,520

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第1期中間計算期間 自 2023年 3月24日 至 2023年 9月23日	第2期中間計算期間 自 2024年 3月19日 至 2024年 9月18日
営業収益		
受取利息	1	7,190
有価証券売買等損益	257,196	5,285,486
為替差損益	1,340,914	13,837,736
営業収益合計	1,083,717	19,130,412
営業費用		
支払利息	71	1
受託者報酬	16,483	278,055
委託者報酬	881,021	14,831,771
その他費用	10,112	41,624
営業費用合計	907,687	15,151,451
営業利益又は営業損失（ ）	1,991,404	3,978,961
経常利益又は経常損失（ ）	1,991,404	3,978,961
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,991,404	3,978,961
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	31,696	317,859
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	121,464,555
剰余金増加額又は欠損金減少額	24,579,763	148,497,949
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	24,579,763	148,497,949
剰余金減少額又は欠損金増加額	201,512	3,030,185
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	201,512	3,030,185
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	22,355,151	270,593,421

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第2期中間計算期間 自 2024年3月19日 至 2024年9月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 (2024年3月18日現在)	第2期中間計算期間 (2024年9月18日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	1,000,497,782口	2,023,249,551口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1214円 (1万口当たりの純資産額11,214円)	1口当たり純資産額 1.1337円 (1万口当たりの純資産額11,337円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期中間計算期間 (2024年9月18日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>

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

(デリバティブ取引に関する注記)

第1期(2024年3月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	153,457,559	-	156,216,405	2,758,846
	小計	153,457,559	-	156,216,405	2,758,846
合計		153,457,559	-	156,216,405	2,758,846

第2期中間計算期間(2024年9月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	310,072,820	-	306,568,288	3,504,532
	小計	310,072,820	-	306,568,288	3,504,532
合計		310,072,820	-	306,568,288	3,504,532

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

項 目	第1期 (2024年3月18日現在)	第2期中間計算期間 (2024年9月18日現在)
期首元本額	1,000,000円	1,000,497,782円
期中追加設定元本額	1,002,889,516円	1,045,977,135円
期中一部解約元本額	3,391,734円	23,225,366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)】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位 : 円)

	第1期 (2024年 3月18日現在)	第2期中間計算期間 (2024年 9月18日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	170,958	87,809
コール・ローン	6,378,187	12,942,595
親投資信託受益証券	666,221,024	1,958,122,133
派生商品評価勘定	-	3,678,966
未収入金	667,989	6,947,785
流動資産合計	673,438,158	1,981,779,288
資産合計	673,438,158	1,981,779,288
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,957,970	41,265
未払金	-	21,842
未払受託者報酬	60,421	203,159
未払委託者報酬	3,224,428	10,837,578
その他未払費用	10,025	30,385
流動負債合計	5,252,844	11,134,229
負債合計	5,252,844	11,134,229
純資産の部		
元本等		
元本	580,404,012	1,693,362,569
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	87,781,302	277,282,490
(分配準備積立金)	27,762,621	27,364,106
元本等合計	668,185,314	1,970,645,059
純資産合計	668,185,314	1,970,645,059
負債純資産合計	673,438,158	1,981,779,288

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第1期中間計算期間 自 2023年 3月24日 至 2023年 9月23日	第2期中間計算期間 自 2024年 3月19日 至 2024年 9月18日
営業収益		
受取利息	1	5,090
有価証券売買等損益	968,164	24,908,891
為替差損益	809,375	18,671,658
営業収益合計	158,790	6,232,143
営業費用		
支払利息	10	1
受託者報酬	7,323	203,159
委託者報酬	392,182	10,837,578
その他費用	8,747	30,385
営業費用合計	408,262	11,071,123
営業利益又は営業損失（ ）	249,472	17,303,266
経常利益又は経常損失（ ）	249,472	17,303,266
中間純利益又は中間純損失（ ）	249,472	17,303,266
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	38,194	48,834
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	87,781,302
剰余金増加額又は欠損金減少額	13,225,237	209,202,006
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	13,225,237	209,202,006
剰余金減少額又は欠損金増加額	231,669	2,348,718
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	231,669	2,348,718
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	12,782,290	277,282,490

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第2期中間計算期間 自 2024年3月19日 至 2024年9月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 (2024年3月18日現在)	第2期中間計算期間 (2024年9月18日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	580,404,012口	1,693,362,569口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1512円 (1万口当たりの純資産額11,512円)	1口当たり純資産額 1.1637円 (1万口当たりの純資産額11,637円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期中間計算期間 (2024年9月18日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>

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

(デリバティブ取引に関する注記)

第1期(2024年3月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	112,230,444	-	114,188,414	1,957,970
	小計	112,230,444	-	114,188,414	1,957,970
合計		112,230,444	-	114,188,414	1,957,970

第2期中間計算期間(2024年9月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	318,663,823	-	315,026,122	3,637,701
	小計	318,663,823	-	315,026,122	3,637,701
合計		318,663,823	-	315,026,122	3,637,701

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

項 目	第1期 (2024年3月18日現在)	第2期中間計算期間 (2024年9月18日現在)
期首元本額	1,000,000円	580,404,012円
期中追加設定元本額	582,651,620円	1,127,178,081円
期中一部解約元本額	3,247,608円	14,219,524円

【三井住友D S ・ F W専用ポートフォリオ・レベル5（積極成長型）】

（ 1 ）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 （2024年 3月18日現在）	第2期中間計算期間 （2024年 9月18日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	103,395	29,079
コール・ローン	3,857,508	4,286,045
親投資信託受益証券	238,174,768	635,873,973
派生商品評価勘定	-	1,424,322
未収入金	270,237	2,628,614
流動資産合計	242,405,908	644,242,033
資産合計	242,405,908	644,242,033
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	867,288	3,343
未払受託者報酬	23,649	66,785
未払委託者報酬	1,262,823	3,564,844
その他未払費用	4,079	9,929
流動負債合計	2,157,839	3,644,901
負債合計	2,157,839	3,644,901
純資産の部		
元本等		
元本	202,763,721	534,951,109
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	37,484,348	105,646,023
（分配準備積立金）	12,572,126	12,555,878
元本等合計	240,248,069	640,597,132
純資産合計	240,248,069	640,597,132
負債純資産合計	242,405,908	644,242,033

（ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第1期中間計算期間 自 2023年 3月24日 至 2023年 9月23日	第2期中間計算期間 自 2024年 3月19日 至 2024年 9月18日
営業収益		
受取利息	-	1,256
有価証券売買等損益	1,218,187	5,990,795
為替差損益	576,160	6,135,125
営業収益合計	642,027	145,586
営業費用		
支払利息	6	-
受託者報酬	4,520	66,785
委託者報酬	242,974	3,564,844
その他費用	8,323	9,929
営業費用合計	255,823	3,641,558
営業利益又は営業損失（ ）	386,204	3,495,972
経常利益又は経常損失（ ）	386,204	3,495,972
中間純利益又は中間純損失（ ）	386,204	3,495,972
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	1,268	7,355
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	37,484,348
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,243,167	71,751,000
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,243,167	71,751,000
剰余金減少額又は欠損金増加額	8,698	85,998
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	8,698	85,998
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	7,619,405	105,646,023

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第2期中間計算期間 自 2024年3月19日 至 2024年9月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 (2024年3月18日現在)	第2期中間計算期間 (2024年9月18日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	202,763,721口	534,951,109口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1849円 (1万口当たりの純資産額11,849円)	1口当たり純資産額 1.1975円 (1万口当たりの純資産額11,975円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期中間計算期間 (2024年9月18日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>

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

(デリバティブ取引に関する注記)

第1期(2024年3月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	47,932,703	-	48,799,991	867,288
	小計	47,932,703	-	48,799,991	867,288
合計		47,932,703	-	48,799,991	867,288

第2期中間計算期間(2024年9月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	121,945,112	-	120,524,133	1,420,979
	小計	121,945,112	-	120,524,133	1,420,979
合計		121,945,112	-	120,524,133	1,420,979

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

項目	第1期 (2024年3月18日現在)	第2期中間計算期間 (2024年9月18日現在)
期首元本額	1,000,000円	202,763,721円
期中追加設定元本額	207,518,523円	332,624,030円
期中一部解約元本額	5,754,802円	436,642円

(参考)

「三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）」、「三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）」、「三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3（安定成長型）」、「三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）」および「三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5（積極成長型）」は、「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「エマージング株式インデックス・マザーファンド」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」、「ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド」、「米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド」、「Jリート・インデックス・マザーファンド」、「外国リート・インデックス・マザーファンド」および「ゴールド・インデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。
なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

(1)貸借対照表

(単位：円)

(2024年9月18日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	38,167,895
コール・ローン	5,625,732,880
株式	316,252,739,240
派生商品評価勘定	3,029,800
未収配当金	125,467,439
前払金	76,945,000
差入委託証拠金	499,906,583
流動資産合計	322,621,988,837
資産合計	322,621,988,837
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	56,683,700
未払解約金	27,668,697
流動負債合計	84,352,397

負債合計	84,352,397
純資産の部	
元本等	
元本	70,455,254,248
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	252,082,382,192
元本等合計	322,537,636,440
純資産合計	322,537,636,440
負債純資産合計	322,621,988,837

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2024年3月19日 至 2024年9月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。

(貸借対照表に関する注記)

項 目	(2024年9月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	70,455,254,248口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 4.5779円 (1万口当たりの純資産額45,779円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項 目	(2024年9月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(2024年9月18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	6,388,213,900	-	6,334,560,000	53,653,900
	小計	6,388,213,900	-	6,334,560,000	53,653,900
合計		6,388,213,900	-	6,334,560,000	53,653,900

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(2024年9月18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	68,414,614,168円
同期中における追加設定元本額	5,802,537,616円
同期中における一部解約元本額	3,761,897,536円
2024年9月18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	9,728,098,656円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	951,093,583円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,200,376,951円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,629,902,384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)	130,862,270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)	3,042,957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)	124,228,530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(TOPIX)	1,595,096,060円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	29,537,164,184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	70,040,729円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	220,110,574円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	221,025,089円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	905,753,876円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	548,021,447円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	677,825,806円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	66,541,957円
三井住友DS・国内株式インデックス年金ファンド	1,493,228,780円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	42,130,422円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	254,742,952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	9,795,302円
日興FWS・日本株インデックス	2,802,285,684円
三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド	228,075,914円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	23,040,928円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	14,474,296円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	15,224,099円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	8,267,077円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	5,275,441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)	24,192,794円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	117,393,795円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	123,701,189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)	47,814,523円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	1,993,156,333円
バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉	7,061,523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〉	696,968,941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〉	3,842,256,121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>	17,992,772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>	53,729,988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>	28,432,856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）	147,428,669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>	57,199,661円
合計	70,455,254,248円

外国株式インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

(2024年9月18日現在)

資産の部

流動資産

預金	7,836,617,597
金銭信託	3,967,132
コール・ローン	584,732,980
株式	763,686,484,909
投資証券	16,565,153,708
派生商品評価勘定	11,027,558
未収入金	13,786,978
未収配当金	1,055,863,006
差入委託証拠金	3,368,064,868
流動資産合計	793,125,698,736

資産合計

793,125,698,736

負債の部

流動負債

派生商品評価勘定	386,832
未払解約金	260,061,224

流動負債合計	260,448,056
負債合計	260,448,056
純資産の部	
元本等	
元本	89,306,311,702
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	703,558,938,978
元本等合計	792,865,250,680
純資産合計	792,865,250,680
負債純資産合計	793,125,698,736

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2024年3月19日 至 2024年9月18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>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2024年9月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	89,306,311,702口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 8.8780円 (1万口当たりの純資産額88,780円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2024年9月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（株式、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。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

(2024年9月18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 DEC24	9,968,028,145	-	9,969,777,152	1,749,007
	SPI 200 FUTURES SEP24	363,278,689	-	371,059,313	7,780,624
	FTSE 100 IDX FUT DEC24	500,198,848	-	500,109,314	89,534
	EURO STOXX 50 DEC24	1,711,160,565	-	1,711,597,822	437,257
	小計	12,542,666,247	-	12,552,543,601	9,877,354
	合計	12,542,666,247	-	12,552,543,601	9,877,354

（注）1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(単位：円)

	契約額等
--	------

区分	種類		うち 1年超	時価	評価損益
市場取引以 外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	260,600,264	-	261,656,140	1,055,876
	ユーロ	40,632,755	-	40,629,840	2,915
	小計	301,233,019	-	302,285,980	1,052,961
	売建				
	アメリカ・ドル	92,876,480	-	92,876,480	-
	オーストラリア・ド ル	28,461,900	-	28,751,490	289,590
	小計	121,338,380	-	121,627,970	289,590
	合計		422,571,399	-	423,913,950

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(2024年9月18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	84,869,986,453円
同期中における追加設定元本額	8,670,607,049円
同期中における一部解約元本額	4,234,281,800円
2024年9月18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	44,978,651,544円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	247,742,375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)	28,648,686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	1,210,624,971円
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	24,324,748,344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DS・DCターゲットイヤーファンド2050	33,382,010円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	159,273,974円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	147,413,953円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	589,741,929円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	365,764,014円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	523,440,476円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	70,941,793円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	3,125,273,264円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	11,128,354円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	57,165,915円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	61,059,103円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	4,714,636円
SMB C・DCインデックスファンド(M S C Iコクサイ)	2,314,045,976円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	165,327,238円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	3,650,696,562円
三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド	167,369,130円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	9,630,196円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	6,305,022円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	7,095,394円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	3,948,075円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	2,562,663円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	175,874円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	5,197,848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)	25,812,503円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	27,593,843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)	10,630,651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)	235,799,660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>	1,796,780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 2 5 <適格機関投資家専用>	244,702,267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>	451,986,789円
S M A M・バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	2,044,178,308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>	6,385,797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>	32,476,182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>	336,590,787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 2 5 <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 5 0 <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 4 0 <適格機関投資家専用>	183,205,513円

SMAM・バランスファンドVA35<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・VAS(適格機関投資家専用)	165,260,941円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	35,586,512円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	4,094,878円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	3,762,642円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	3,045,479円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	9,255,993円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	31,912,804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>	68,971,315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>	28,947,304円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	113,387,274円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	42,612,522円
SMAM・外国株式インデックスファンドSA<適格機関投資家限定>	20,452,057円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	17,673,700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>	11,287,097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>	18,145,014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>	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%)<適格機関投資家限定>	27,929,693円
合計	89,306,311,702円

エマージング株式インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

(2024年9月18日現在)

資産の部

流動資産

預金	2,418,913,251
金銭信託	1,672,977
コール・ローン	246,587,353
株式	39,660,184,811
投資信託受益証券	1,543,089,037
投資証券	3,301,640,641
派生商品評価勘定	35,797,015
未収入金	159,215
未収配当金	107,195,374
差入委託証拠金	667,199,361
流動資産合計	47,982,439,035

資産合計

47,982,439,035

負債の部

流動負債

派生商品評価勘定	21,222,465
未払解約金	10,501,460
流動負債合計	31,723,925

負債合計

31,723,925

純資産の部	
元本等	
元本	23,889,928,774
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	24,060,786,336
元本等合計	47,950,715,110
純資産合計	47,950,715,110
負債純資産合計	47,982,439,035

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2024年3月19日 至 2024年9月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資信託受益証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項 目	(2024年9月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	23,889,928,774口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.0072円 (1万口当たりの純資産額20,072円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2024年9月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（株式、投資信託受益証券、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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18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	3,351,728,329	-	3,365,483,172	13,754,843
	小計	3,351,728,329	-	3,365,483,172	13,754,843
合計		3,351,728,329	-	3,365,483,172	13,754,843

(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	166,900,000	-	167,719,014	819,014
	小計	166,900,000	-	167,719,014	819,014
	売建				

	アメリカ・ドル	70,000,000	-	69,999,307	693
	小計	70,000,000	-	69,999,307	693
	合 計	236,900,000	-	237,718,321	819,707

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(2024年9月18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	22,032,341,427円
同期中における追加設定元本額	3,226,519,337円
同期中における一部解約元本額	1,368,931,990円
2024年9月18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	12,841,087,357円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	3,533,976,621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	73,979,089円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	129,079,159円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	100,737,280円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	495,929,929円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	343,107,308円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	528,563,853円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	154,489,712円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	10,500,026円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	445,096,411円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	4,601,699,823円
三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド	101,619,358円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	20,642,992円

三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	13,696,789円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	15,545,306円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	8,753,989円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	5,534,686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)	8,293,357円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	39,807,868円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	42,432,334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)	16,463,051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>	62,221,797円
合計	23,889,928,774円

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18日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	2,951,051
コール・ローン	434,968,287
国債証券	107,160,813,130
地方債証券	11,576,071,050
特殊債券	10,143,031,657
社債券	7,734,655,600
未収入金	454,306,600
未収利息	407,040,513
前払費用	26,517,632
流動資産合計	137,940,355,520
資産合計	
137,940,355,520	
負債の部	
流動負債	
未払解約金	172,471,000
流動負債合計	172,471,000
負債合計	
172,471,000	
純資産の部	
元本等	
元本	114,526,606,193
剰余金	
剰余金又は欠損金()	23,241,278,327
元本等合計	137,767,884,520
純資産合計	
137,767,884,520	
負債純資産合計	
137,940,355,520	

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2024年3月19日 至 2024年9月18日
----	------------------------------

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

(貸借対照表に関する注記)

項 目	(2024年9月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	114,526,606,193口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2029円 (1万口当たりの純資産額12,029円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項 目	(2024年9月18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、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(2024年9月18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	109,512,290,248円

同期中における追加設定元本額	16,202,564,721円
同期中における一部解約元本額	11,188,248,776円
2024年9月18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)	10,343,539,283円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	16,888,922,140円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	4,452,977,078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)	882,745,466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)	1,290,173,672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)	881,997,715円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	135,923,163円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	2,571,602,308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	395,038,749円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	458,193,684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)	352,510,961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	264,877,000円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	129,129,979円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	83,137,314円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	16,592,600円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	10,595,273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)	117,834,547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)	151,565,792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>	7,345,516,444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>	5,873,840,831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>	15,313,360,430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>	1,771,183,954円

SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,237,429,887円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,071,263,718円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	7,229,348,513円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	885,421,999円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	365,526,555円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	416,257,652円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	140,691,746円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	54,178,432円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	1,053,377,150円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	1,912,644,726円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	532,613,671円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	228,840,970円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	26,228,031円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	234,896,115円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	4,480,421,738円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	1,372,264,667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>	665,197,090円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	1,061,464,793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>	4,256,860,308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>	613,126,713円
合計	114,526,606,193円

外国債券パッシブ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位:円)

(2024年9月18日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	255,819,866
金銭信託	8,143,846
コール・ローン	1,200,357,052
国債証券	177,522,332,795
未収入金	109,000,000
未収利息	1,338,421,632
前払費用	108,699,144
流動資産合計	180,542,774,335
資産合計	
180,542,774,335	
負債の部	
流動負債	
未払解約金	80,805,810
流動負債合計	80,805,810
負債合計	
80,805,810	
純資産の部	
元本等	

元本		80,629,901,493
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		99,832,067,032
元本等合計		180,461,968,525
純資産合計		180,461,968,525
負債純資産合計		180,542,774,335

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2024年3月19日 至 2024年9月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項 目	(2024年9月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	80,629,901,493口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.2382円 (1万口当たりの純資産額22,382円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項 目	(2024年9月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。

	<p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(2024年9月18日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	81,276,928,619円
同期中における追加設定元本額	6,293,480,310円
同期中における一部解約元本額	6,940,507,436円
2024年9月18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	28,345,678,996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)	167,861,301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)	353,704,343円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	19,525,984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)	397,092,412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	1,360,378,043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	7,277,256円
日興FWS ・先進国債インデックス (為替ヘッジなし)	4,472,661,857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D S ・DCターゲットイヤーファンド2035	14,950,436円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2040	9,480,528円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2045	10,584,382円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2055	6,063,479円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2065	3,874,367円
三井住友D S ・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D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル2 (安定型)	3,989,577円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル3 (安定成長型)	18,685,645円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル4 (成長型)	18,766,300円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル5 (積極成長型)	7,167,837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>	5,458,669,632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>	3,434,094,933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>	8,180,290,949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>	1,106,440,614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>	5,703,411,356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)	267,494,495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>	236,521,857円
合計	80,629,901,493円

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

(2024年9月18日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	55,069,173
金銭信託	1,115,720
コール・ローン	164,450,848
国債証券	36,169,343,390
派生商品評価勘定	877,879,900
未収利息	201,444,371
前払費用	93,940,268
流動資産合計	37,563,243,670
資産合計	
37,563,243,670	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,863,395
未払解約金	45,205,760
流動負債合計	48,069,155
負債合計	
48,069,155	
純資産の部	
元本等	
元本	30,168,816,295
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	7,346,358,220
元本等合計	37,515,174,515
純資産合計	
37,515,174,515	
負債純資産合計	
37,563,243,670	

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2024年3月19日 至 2024年9月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p>

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2024年9月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	30,168,816,295口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2435円 (1万口当たりの純資産額12,435円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2024年9月18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)

(2024年9月18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

	契 約 額 等	
--	---------	--

区 分	種 類		うち 1年超	時 価	評価損益
市場取引以 外の取引	為替予約取引				
	買建				
	アメリカ・ドル	33,402,971	-	32,503,600	899,371
	カナダ・ドル	1,076,790	-	1,040,300	36,490
	オーストラリア・ド ル	1,964,476	-	1,913,500	50,976
	デンマーク・クロー ネ	215,469	-	210,900	4,569
	メキシコ・ペソ	1,978,322	-	1,990,548	12,226
	ユーロ	22,491,831	-	22,028,300	463,531
	小計	61,129,859	-	59,687,148	1,442,711
	売建				
	アメリカ・ドル	17,116,557,245	-	16,691,305,200	425,252,045
	カナダ・ドル	740,241,648	-	715,726,400	24,515,248
	オーストラリア・ド ル	491,624,572	-	478,375,000	13,249,572
	シンガポール・ドル	338,519,497	-	331,968,000	6,551,497
	ニュージーランド・ ドル	102,374,761	-	99,038,850	3,335,911
	イギリス・ポンド	2,013,352,923	-	1,967,658,350	45,694,573
	イスラエル・シユケ ル	116,330,735	-	108,814,212	7,516,523
	デンマーク・クロー ネ	100,735,779	-	98,701,200	2,034,579
	ノルウェー・クロー ネ	57,914,153	-	56,364,750	1,549,403
	スウェーデン・ク ローナ	55,289,960	-	54,171,000	1,118,960
	メキシコ・ペソ	267,650,821	-	269,018,876	1,368,055
	オフショア・人民元	4,042,344,219	-	3,926,768,532	115,575,687
	ポーランド・ズロチ	192,422,075	-	188,286,903	4,135,172
	ユーロ	11,158,055,251	-	10,930,757,150	227,298,101
	小計	36,793,413,639	-	35,916,954,423	876,459,216
	合 計	36,854,543,498	-	35,976,641,571	875,016,505

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

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

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(2024年9月18日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	17,274,485,812円
同期中における追加設定元本額	13,859,396,527円
同期中における一部解約元本額	965,066,044円
2024年9月18日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,997,842,238円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	2,201,553,605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	1,260,478,663円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	3,398,635,377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・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	127,986,090円
日興FWS・先進国債インデックス(為替ヘッジあり)	331,686,007円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	14,903,918円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	141,698,232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)	367,591,701円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	182,502,932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)	16,859,938円
SMAM・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
SMAM・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	10,283,969,685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>	726,987,837円
合計	30,168,816,295円

米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

(1)貸借対照表

(単位:円)

(2024年9月18日現在)

資産の部

流動資産	
預金	366,119,198
金銭信託	507,466
コール・ローン	74,797,606
国債証券	9,546,284,139
派生商品評価勘定	462,600
未収入金	11,000,000
未収利息	124,753,739
前払費用	8,946,100
流動資産合計	10,132,870,848
資産合計	
	10,132,870,848
負債の部	
流動負債	
未払金	147,502,895
未払解約金	1,600,388
流動負債合計	149,103,283
負債合計	
	149,103,283
純資産の部	
元本等	
元本	9,104,153,324
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	879,614,241
元本等合計	9,983,767,565
純資産合計	
	9,983,767,565
負債純資産合計	
	10,132,870,848

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2024年3月19日 至 2024年9月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>

3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。
-------------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2024年9月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	9,104,153,324口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0966円 (1万口当たりの純資産額10,966円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2024年9月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2024年9月18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	63,257,400	-	63,720,000	462,600
	小計	63,257,400	-	63,720,000	462,600
合計		63,257,400	-	63,720,000	462,600

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（その他の注記）

（2024年9月18日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	7,493,553,376円
同期中における追加設定元本額	1,757,316,466円
同期中における一部解約元本額	146,716,518円
2024年9月18日現在の元本の内訳	
日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジあり）	299,442,944円
日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジなし）	7,514,312,058円
三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド	129,771,691円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	132,298,874円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	362,503,867円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	239,161,536円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	61,455,847円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	8,804,420円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	17,655,715円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	11,144,351円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	12,792,849円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	7,242,158円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	4,640,665円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）	311,208円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）	18,833,374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）	107,139,354円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）	124,840,013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）	51,802,400円
合計	9,104,153,324円

Jリート・インデックス・マザーファンド

（1）貸借対照表

（単位：円）

（2024年9月18日現在）

資産の部
流動資産

金銭信託	510,766
コール・ローン	75,284,030
投資証券	15,569,980,500
未収配当金	199,326,352
前払金	68,000
差入委託証拠金	2,141,758
流動資産合計	15,847,311,406
資産合計	15,847,311,406
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	162,400
未払金	39,531,192
未払解約金	6,937,736
流動負債合計	46,631,328
負債合計	46,631,328
純資産の部	
元本等	
元本	6,050,773,615
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	9,749,906,463
元本等合計	15,800,680,078
純資産合計	15,800,680,078
負債純資産合計	15,847,311,406

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2024年3月19日 至 2024年9月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	(2024年9月18日現在)
1. 当計算期間の末日における 受益権の総数	6,050,773,615口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.6113円 (1万口当たりの純資産額26,113円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2024年9月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び 差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する 事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

(2024年9月18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	-	34,840,000	162,400
	小計	35,002,400	-	34,840,000	162,400
	合計	35,002,400	-	34,840,000	162,400

（注）1. 時価の算定方法

リート指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

2) リート指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（その他の注記）

（2024年9月18日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	5,754,272,779円
同期中における追加設定元本額	1,187,395,373円
同期中における一部解約元本額	890,894,537円
2024年9月18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）	60,530,524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	2,830,659,271円
三井住友D S ・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D S ・DCターゲットイヤーファンド2060	4,495,227円
三井住友D S ・国内リートインデックス年金ファンド	399,465,877円
日興FWS・Jリートインデックス	1,131,740,770円
三井住友D S ・国内リートインデックス・ファンド	190,247,563円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2035	6,123,718円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2040	4,111,113円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2045	5,773,534円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2055	3,728,679円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2065	2,393,809円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）	415,601円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）	18,719,566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）	95,922,950円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）	103,711,157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）	40,514,770円
S M A M ・世界リート・インデックスファンドV A <適格機関投資家限定>	2,641,141円
S M A M ・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	69,740,411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>	43,842,620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>	70,225,020円
合計	6,050,773,615円

外国リート・インデックス・マザーファンド

（1）貸借対照表

（単位：円）

（2024年9月18日現在）	
資産の部	
流動資産	
預金	1,345,332,571

金銭信託	2,082,907
コール・ローン	307,008,729
投資証券	39,923,958,197
派生商品評価勘定	662,048
未収入金	2,207,495
未収配当金	136,938,570
流動資産合計	41,718,190,517
資産合計	41,718,190,517
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,165
未払解約金	213,490
流動負債合計	216,655
負債合計	216,655
純資産の部	
元本等	
元本	11,582,944,955
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	30,135,028,907
元本等合計	41,717,973,862
純資産合計	41,717,973,862
負債純資産合計	41,718,190,517

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2024年3月19日 至 2024年9月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	(2024年9月18日現在)
1. 当計算期間の末日における 受益権の総数	11,582,944,955口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.6017円 (1万口当たりの純資産額36,017円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2024年9月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び 差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する 事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

(2024年9月18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	246,500,000	-	246,893,244	393,244
	カナダ・ドル	9,000,000	-	8,997,556	2,444
	オーストラリア・ドル	23,100,000	-	23,231,927	131,927
	シンガポール・ドル	8,800,000	-	8,842,612	42,612
	イギリス・ポンド	13,000,000	-	13,045,317	45,317
	ユーロ	9,900,000	-	9,948,227	48,227
	小計	310,300,000	-	310,958,883	658,883
合計	310,300,000	-	310,958,883	658,883	

（注）1．時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(2024年9月18日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	10,694,933,338円
同期中における追加設定元本額	1,216,774,493円
同期中における一部解約元本額	328,762,876円
2024年9月18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	9,064,778,235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	442,792,646円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	61,625,528円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	1,123,512,371円
三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド	154,702,343円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	3,744,661円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	2,066,872円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	2,234,489円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	1,250,247円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	817,062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)	1,130,199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）	6,189,308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）	6,844,237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）	2,761,958円
S M A M ・ 世界リート・インデックスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	28,476,244円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド< 適格機関投資家限定 >	51,715,222円
合 計	11,582,944,955円

ゴールド・インデックス・マザーファンド

(1) 貸借対照表

(単位：円)

(2024年9月18日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	168,886,281
金銭信託	835,400
コール・ローン	123,133,302
投資信託受益証券	12,489,183,030
流動資産合計	12,782,038,013
資産合計	12,782,038,013
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	41
未払金	28,862,156
未払解約金	1,211,649
流動負債合計	30,073,846
負債合計	30,073,846
純資産の部	
元本等	
元本	7,246,594,854
剰余金	
剰余金又は欠損金 ()	5,505,369,313
元本等合計	12,751,964,167
純資産合計	12,751,964,167
負債純資産合計	12,782,038,013

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 2024年3月19日 至 2024年9月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(2024年9月18日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	7,246,594,854口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.7597円 (1万口当たりの純資産額17,597円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(2024年9月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資信託受益証券）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
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18日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

	契 約 額 等	
--	---------	--

区 分	種 類		うち 1 年超	時 価	評価損益
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	29,169,641	-	29,169,600	41
	小計	29,169,641	-	29,169,600	41
	合 計	29,169,641	-	29,169,600	41

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(2024年9月18日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	6,243,929,441円
同期中における追加設定元本額	1,236,964,616円
同期中における一部解約元本額	234,299,203円
2024年9月18日現在の元本の内訳	
日興FWS・ゴールド（為替ヘッジあり）	201,831,311円
日興FWS・ゴールド（為替ヘッジなし）	6,163,096,130円
三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）	618,561,392円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）	447,328円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）	21,016,266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）	104,311,945円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）	101,180,391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）	36,150,091円
合 計	7,246,594,854円

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)

2024年9月30日現在

資産総額	44,652,969円
負債総額	24,709円
純資産総額(-)	44,628,260円
発行済口数	42,604,774口
1口当たり純資産額(/) (1万口当たり純資産額)	1.0475円 (10,475円)

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)

2024年9月30日現在

資産総額	620,440,008円
負債総額	409,769円
純資産総額(-)	620,030,239円
発行済口数	558,929,661口
1口当たり純資産額(/) (1万口当たり純資産額)	1.1093円 (11,093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)

2024年9月30日現在

資産総額	2,401,820,227円
負債総額	1,629,375円
純資産総額(-)	2,400,190,852円
発行済口数	2,086,841,028口
1口当たり純資産額(/) (1万口当たり純資産額)	1.1502円 (11,502円)

三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)

2024年9月30日現在

資産総額	2,031,900,343円
負債総額	1,383,257円
純資産総額(-)	2,030,517,086円
発行済口数	1,713,148,296口
1口当たり純資産額(/) (1万口当たり純資産額)	1.1853円 (11,853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)

2024年9月30日現在

資産総額	668,511,990円
負債総額	432,579円
純資産総額（ - ）	668,079,411円
発行済口数	545,635,005口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たり純資産額）	1.2244円 (12,244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。

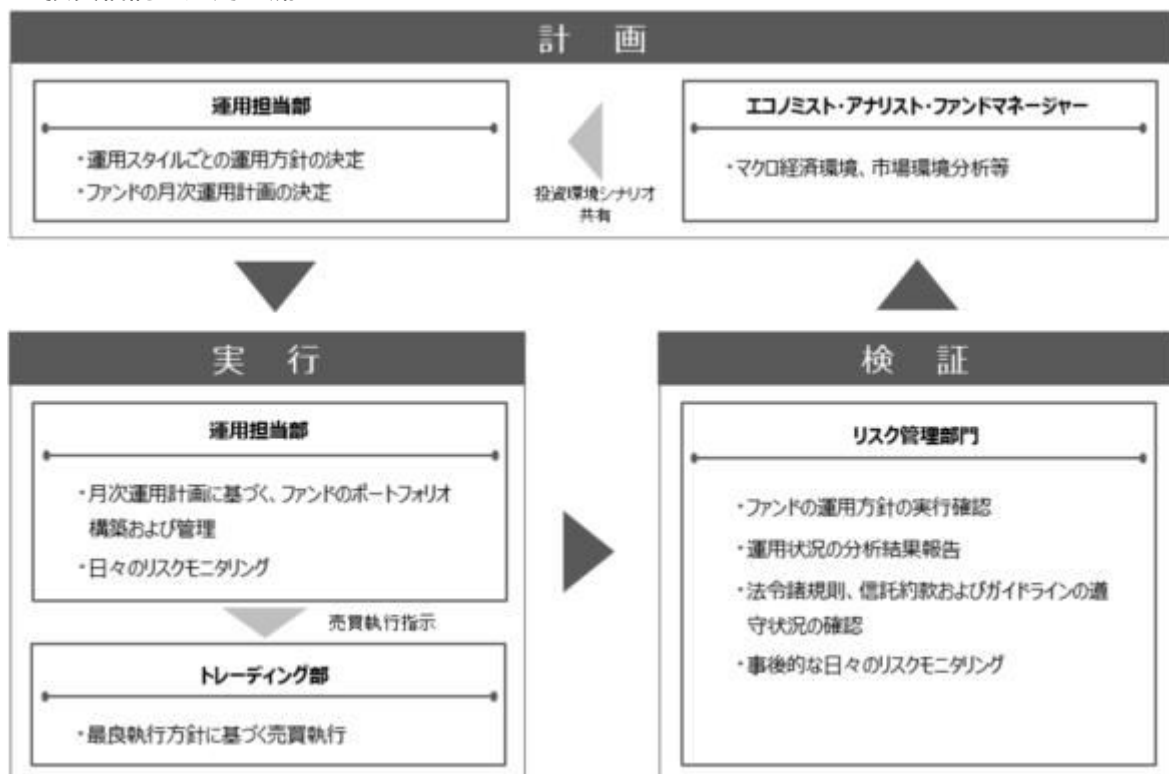
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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

有形固定資産合計	2,006,427	1,784,901
無形固定資産		
ソフトウェア	2,414,295	2,606,617
ソフトウェア仮勘定のれん	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)
負債の部		
流動負債		
リース債務	2,564	1,960
顧客からの預り金	11,094	21,728
その他の預り金	128,069	166,944
未払金		
未払収益分配金	2,013	1,927
未払償還金	1,312	1,253
未払手数料	5,194,011	6,580,971
その他未払金	259,542	642,514
未払費用	6,370,986	7,405,559
未払消費税等	406,770	937,155
未払法人税等	333,009	5,104,541
賞与引当金	1,801,492	2,854,060
資産除去債務	13,940	-
その他の流動負債	73,657	17,443
流動負債合計	14,598,465	23,736,060
固定負債		
リース債務	1,960	-
繰延税金負債	550,493	-
退職給付引当金	5,027,832	4,941,989
固定負債合計	5,580,287	4,941,989
負債合計	20,178,752	28,678,050
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
その他資本剰余金	73,466,962	73,466,962
資本剰余金合計	82,095,946	82,095,946

利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	3,391,568	27,075,963
利益剰余金合計	3,675,814	27,360,208
株主資本計	87,771,760	111,456,155
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	142,558	50,045
評価・換算差額等合計	142,558	50,045
純資産合計	87,629,201	111,406,109
負債・純資産合計	107,807,953	140,084,160

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		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	㈱三井住友 銀行	東京都 千代田区	1,770,996,505	銀行業	-	% 投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	5,279,199	未払 手数料	1,265,651
親会社 の子会社	SMBC日興 証券㈱	東京都 千代田区	10,000,000	証券業	-	% 投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	7,030,381	未払 手数料	1,288,749

(注)取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2.親会社に関する注記

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

当事業年度(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1.関連当事者との取引

(1)兄弟会社等

(単位：千円)

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

(注)取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2.親会社に関する注記

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社	㈱三井住友フィナンシャルグループ	東京都千代田区	2,344,038,000	銀行業	50.1%	持株会社	子会社株式の売却(売却価格)	24,000,000	-	-
							子会社株式売却益	14,096,622		

(注) 子会社株式の売却及び子会社株式売却益

取引価額については、企業価値を勘案し、両社協議のうえ合理的に決定しております。

(1株当たり情報)

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

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

2. 1株当たり当期純利益の算定上の基礎は、次のとおりであります。

	前事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	当事業年度 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
1株当たり当期純利益		
当期純利益(千円)	2,097,028	25,276,287
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(千円)	2,097,028	25,276,287
期中平均株式数(株)	33,870,060	33,870,060

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

イ 定款の変更、その他の重要事項

(イ) 定款の変更

該当ありません。

(ロ) その他の重要事項

該当ありません。

ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実

該当ありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

イ 受託会社

(イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社

(ロ) 資本金の額 342,037百万円（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
株式会社広島銀行	54,573	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

ロ 販売会社

委託会社との間で締結された販売契約に基づき、日本における当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、一部解約の実行の請求の受付け、収益分配金、償還金の支払事務等を行います。

3【資本関係】

（持株比率5%以上を記載しています。）

該当ありません。

第3【その他】

1 目論見書の表紙から本文の前までおよび裏表紙の記載について

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

(2) 委託会社の金融商品取引業者登録番号を記載することがあります。

(3) 委託会社のホームページのアドレスおよび他のインターネットのアドレス（これらのアドレス

をコード化した図形等も含む）を記載することがあります。

- (4) 請求目論見書の入手方法および投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨を記載することがあります。
 - (5) 目論見書の使用開始日を記載することがあります。
 - (6) 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。
 - (7) 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨を記載することがあります。
 - (8) 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載をすることがあります。
 - (9) 当ファンドのロゴおよび委託会社のロゴを記載することがあります。
 - (10) ファンドの形態および属性、申込みにかかる事項、ユニバーサルデザインフォントマークを記載することがあります。
 - (11) 写真、イラスト、図案およびキャッチコピーを採用することがあります。また、ファンドの管理番号等を記載することがあります。
- 2 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。
 - 3 当ファンドの投資信託約款の全文を請求目論見書に掲載することがあります。
 - 4 目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」と称して使用することがあります。
 - 5 評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。
 - 6 有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドの実質的な投資対象資産に共通性がある場合には、当該複数のファンドを一つの投資信託説明書（交付目論見書）で説明することがあります。また、有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドにかかる投資信託説明書（交付目論見書）および投資信託説明書（請求目論見書）を一体のものとして使用することがあります。

独立監査人の監査報告書

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 . X B R Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年6月5日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）の2023年3月24日から2024年3月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）の2024年3月18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。

独立監査人の監査報告書

2024年6月5日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）の2023年3月24日から2024年3月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）の2024年3月18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。

独立監査人の監査報告書

2024年6月5日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3（安定成長型）の2023年3月24日から2024年3月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3（安定成長型）の2024年3月18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。

独立監査人の監査報告書

2024年6月5日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）の2023年3月24日から2024年3月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）の2024年3月18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。

独立監査人の監査報告書

2024年6月5日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5（積極成長型）の2023年3月24日から2024年3月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5（積極成長型）の2024年3月18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。

独立監査人の中間監査報告書

2024年12月4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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）の2024年3月19日から2024年9月18日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）の2024年9月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年3月19日から2024年9月18日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2024年12月4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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）の2024年3月19日から2024年9月18日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）の2024年9月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年3月19日から2024年9月18日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2024年12月4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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3（安定成長型）の2024年3月19日から2024年9月18日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3（安定成長型）の2024年9月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年3月19日から2024年9月18日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2024年12月4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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）の2024年3月19日から2024年9月18日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）の2024年9月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年3月19日から2024年9月18日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2024年12月4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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5（積極成長型）の2024年3月19日から2024年9月18日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5（積極成長型）の2024年9月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年3月19日から2024年9月18日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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